

# 创金合信量化核心混合型证券投资基金

## 2017 年半年度报告摘要

2017 年 06 月 30 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2017 年 08 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 03 月 27 日起至 2017 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                 |                 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金简称            | 创金合信量化核心混合      |                 |
| 基金主代码           | 004359          |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式          |                 |
| 基金合同生效日         | 2017年03月27日     |                 |
| 基金管理人           | 创金合信基金管理有限公司    |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司    |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 641,645,718.78份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期             |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 创金合信量化核心混合A     | 创金合信量化核心混合C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 004359          | 004360          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 252,867,627.16份 | 388,778,091.62份 |

### 2.2 基金产品说明

|               |  |            |
|---------------|--|------------|
| 投资目标          | 在控制风险的同时，追求超越业绩比较基准的投资回报。  |            |
| 投资策略          | 本基金将采取定量与定性相结合的方法，运用“自上而下”的资产配置逻辑，形成对大类资产预期收益及风险的判断，进而确定资产配置的具体比例。其中，本基金在进行资产配置决策时将主要考虑宏观经济、政策预期、产业经济、市场情绪、投资者行为等因素。 |            |
| 业绩比较基准        | 沪深300指数收益率×80%+中债综合财富（总值）指数收益率×20%   |            |
| 风险收益特征        | 本基金为混合型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。   |            |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 本基金为混合型基金，   | 本基金为混合型基金， |

|  |  |  |
|--|--|--|
|  | 长期来看，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 | 长期来看，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 |
|--|--|--|

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人         | 基金托管人                      |
|---------|---------------|----------------------------|
| 名称      | 创金合信基金管理有限公司  | 中国工商银行股份有限公司               |
| 信息披露负责人 | 姓名            | 梁绍锋                        |
|         | 联系电话          | 0755-23838908              |
|         | 电子邮箱          | liangshaofeng@cjhxfund.com |
| 客户服务电话  | 400-868-0666  | 95588                      |
| 传真      | 0755-25832571 | 010-66105798               |

### 2.4 信息披露方式

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.cjhxfund.com      |
| 基金半年度报告备置地点          | 深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年03月27日-2017年06月30日) |                 |
|---------------|------------------------------|-----------------|
|               | 创金合信量化核心混合<br>A              | 创金合信量化核心混合<br>C |
| 本期已实现收益       | -745,180.42                  | -4,300,994.62   |
| 本期利润          | 6,505,207.19                 | 9,029,405.66    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0244                       | 0.0177          |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.59%                        | 2.35%           |

| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期(2017年06月30日) |                |
|---------------|------------------|----------------|
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0018          | -0.0041        |
| 期末基金资产净值      | 259,409,928.44   | 397,920,838.68 |
| 期末基金份额净值      | 1.0259           | 1.0235         |

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 本基金合同生效日为2017年3月27日，截至报告期末，本基金成立不满半年。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信量化核心混合A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 4.56%    | 0.52%       | 4.23%      | 0.54%         | 0.33%  | -0.02% |
| 过去三个月      | 2.72%    | 0.41%       | 4.91%      | 0.50%         | -2.19% | -0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.59%    | 0.40%       | 4.13%      | 0.49%         | -1.54% | -0.09% |

创金合信量化核心混合C

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 4.46%    | 0.52%       | 4.23%      | 0.54%         | 0.23%  | -0.02% |
| 过去三个月 | 2.49%    | 0.41%       | 4.91%      | 0.50%         | -2.42% | -0.09% |

|            |       |       |       |       |        |        |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 2.35% | 0.40% | 4.13% | 0.49% | -1.78% | -0.09% |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

创金合信量化核心混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年03月27日-2017年06月30日)



创金合信量化核心混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年03月27日-2017年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月2日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

报告期内，本公司共发行4只公募基金。截至2017年6月30日，本公司共管理27只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品3只、债券型产品10只、股票型产品3只、货币型产品1只、保本型产品1只；管理的公募基金规模约153.51亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理 | 证券从 | 说明 |
|----|----|-----------|-----|----|
|----|----|-----------|-----|----|

|     |              | 期限         |      | 业年限 |  |
|-----|--------------|------------|------|-----|--|
|     |              | 任职日期       | 离任日期 |     |  |
| 程志田 | 基金经理、量化投资部总监 | 2017-03-27 | -    | 10年 | 程志田先生，中国国籍，金融学硕士，2006年7月加入长江证券股份有限公司任高级研究经理。2009年7月加入国海证券股份有限公司任金融工程总监。2011年7月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，于2011年11月15日至2013年4月15日担任大摩深证300基金的基金经理。2013年9月加入泰康资产管理有限责任公司任量化投资总监。2015年5月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化投资部总监、基金经理。 |

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算的起止时间按照从事证券行业开始时间计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控



及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2017年上半年，我们严格依据量化模型进行投资，并严格进行风险管理。一方面，我们按照量化选股模型进行股票组合构建；另一方面，仓位管理上，我们按照量化择时模型进行操作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值增长率为2.59%，C类净值增长率为2.35%，同期业绩比较基准收益率为4.13%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在过去的半年里，经济数据超预期。2季度GDP及6月份工业、投资、消费、进出口增长均超预期，工业生产延续强势，收入回升支撑消费，企业盈利改善。目前CPI水平较低，因为通胀引发货币政策收紧的可能性很小。经历了过去两年市场调整，当前股市估值略偏低；增量资金进场意愿不明显，市场依然存在较多的结构性机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人在风险控制办公会下设估值小组，组长由公司总经理担任，成员由基金运营部、研究部、监察稽核部、综合部人员组成，实行一人一票制，可邀请专业人士列席，但不具表决权，基金运营部是估值小组的日常办事机构。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在创金合信量化核心混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

| 资 产  | 本期末<br>2017年06月30日 |
|------|--------------------|
| 资 产： |                    |

|                 |                    |
|-----------------|--------------------|
| 银行存款            | 15,786,060.33      |
| 结算备付金           | 41,931,048.23      |
| 存出保证金           | 468,707.66         |
| 交易性金融资产         | 612,763,355.48     |
| 其中：股票投资         | 583,102,355.48     |
| 基金投资            | -                  |
| 债券投资            | 29,661,000.00      |
| 资产支持证券投资        | -                  |
| 贵金属投资           | -                  |
| 衍生金融资产          | -                  |
| 买入返售金融资产        | -                  |
| 应收证券清算款         | -                  |
| 应收利息            | 169,859.61         |
| 应收股利            | -                  |
| 应收申购款           | 735.42             |
| 递延所得税资产         | -                  |
| 其他资产            | -                  |
| 资产总计            | 671,119,766.73     |
| <b>负债和所有者权益</b> | 本期末<br>2017年06月30日 |
| <b>负 债：</b>     |                    |
| 短期借款            | -                  |
| 交易性金融负债         | -                  |
| 衍生金融负债          | -                  |
| 卖出回购金融资产款       | -                  |
| 应付证券清算款         | 7,895,344.57       |
| 应付赎回款           | 3,093,054.71       |
| 应付管理人报酬         | 891,707.30         |
| 应付托管费           | 148,617.87         |
| 应付销售服务费         | 304,837.37         |
| 应付交易费用          | 1,397,728.92       |

|               |                |
|---------------|----------------|
| 应交税费          | -              |
| 应付利息          | -              |
| 应付利润          | -              |
| 递延所得税负债       | -              |
| 其他负债          | 57,708.87      |
| 负债合计          | 13,788,999.61  |
| <b>所有者权益：</b> |                |
| 实收基金          | 641,645,718.78 |
| 未分配利润         | 15,685,048.34  |
| 所有者权益合计       | 657,330,767.12 |
| 负债和所有者权益总计    | 671,119,766.73 |

注：1. 报告截止日2017年6月30日，基金份额总额641,645,718.78份，其中下属A类基金份额252,867,627.16份，C类基金份额388,778,091.62份。下属A类基金份额净值1.0259元，C类基金份额净值1.0235元。

2. 本基金合同生效日为2017年3月27日，2017年半年度实际报告期间为2017年3月27日至2017年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

本报告期：2017年03月27日至2017年06月30日

单位：人民币元

| 项 目               | 本期2017年03月27日（基金合同生效日）<br>至2017年06月30日 |
|-------------------|--|
| <b>一、收入</b>       | 23,604,362.47                          |
| 1. 利息收入           | 2,665,641.07                           |
| 其中：存款利息收入         | 468,584.04                             |
| 债券利息收入            | 181,908.69                             |
| 资产支持证券利息收入        | -                                      |
| 买入返售金融资产收入        | 2,015,148.34                           |
| 其他利息收入            | -                                      |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 304,145.09                             |

|                            |                      |
|----------------------------|----------------------|
| 其中：股票投资收益                  | -1,900,636.00        |
| 基金投资收益                     | -                    |
| 债券投资收益                     | -8,820.00            |
| 资产支持证券投资收益                 | -                    |
| 贵金属投资收益                    | -                    |
| 衍生工具收益                     | -2,725,440.00        |
| 股利收益                       | 4,939,041.09         |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 20,580,787.89        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 53,788.42            |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>8,069,749.62</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 3,003,064.05         |
| 2. 托管费                     | 500,510.68           |
| 3. 销售服务费                   | 1,052,686.71         |
| 4. 交易费用                    | 3,456,065.30         |
| 5. 利息支出                    | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                    |
| 6. 其他费用                    | 57,422.88            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>15,534,612.85</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>15,534,612.85</b> |

注：本基金合同生效日为2017年3月27日，2017年半年度实际报告期间为2017年3月27日至2017年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

本报告期：2017年03月27日至2017年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|  | 2017年03月27日（基金合同生效日）至2017年06月30日 |               |                 |
|--|----------------------------------|---------------|-----------------|
|  | 实收基金                             | 未分配利润         | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 801,997,731.79                   | -             | 801,997,731.79  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                | 15,534,612.85 | 15,534,612.85   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -160,352,013.01                  | 150,435.49    | -160,201,577.52 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 30,490,278.79                    | -131,554.20   | 30,358,724.59   |
| 2. 基金赎回款                               | -190,842,291.80                  | 281,989.69    | -190,560,302.11 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                | -             | -               |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 641,645,718.78                   | 15,685,048.34 | 657,330,767.12  |

注：本基金合同生效日为2017年3月27日，2017年半年度实际报告期间为2017年3月27日至2017年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满半年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

创金合信量化核心混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]第5号《关于准予创金合信量化核心混合型证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共

和《证券投资基金法》和《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币801,695,744.90元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第116号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为801,997,731.79份基金份额，其中认购资金利息折合301,986.89份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品（包括权证、股指期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中债综合财富（总值）指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所指定的重要会计政策和会计估计编制。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2017年3月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险



和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未

实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；（5）在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后，可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；（6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称        | 关联方与本基金的关系          |
|--------------|---------------------|
| 创金合信基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |

|                        |                 |
|------------------------|-----------------|
| 中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)   | 基金托管人、基金代销机构    |
| 深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)     | 基金管理人股东         |
| 第一创业证券股份有限公司(“第一创业证券”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

**6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.8.1.1 股票交易**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.8.1.2 债券交易**

本基金于本期末无通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.8.1.3 债券回购交易**

本基金于本期末无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.8.1.4 权证交易**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金于本期末无应付关联方的佣金。

**6.4.8.2 关联方报酬**

**6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年03月27日(基金合同生效日)至2017年06月30日 |
|-----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,003,064.05                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,887,466.96                           |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               |
|----------------|----------------------------------|
|                | 2017年03月27日（基金合同生效日）至2017年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 500,510.68                       |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                      |             |            |
|----------------|-------------------------|-------------|------------|
|                | 2017年03月27日至2017年06月30日 |             |            |
|                | 创金合信量化核心混合A             | 创金合信量化核心混合C | 合计         |
| 创金合信基金         | -                       | 13.93       | 13.93      |
| 第一创业证券         | -                       | 2,874.03    | 2,874.03   |
| 工商银行           | -                       | 490,335.42  | 490,335.42 |
| 合计             | -                       | 493,223.38  | 493,223.38 |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金的基金资产净值0.8%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给创金合信基金管理有限公司,再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值×0.8%/当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称            | 本期<br>2017年03月27日(基金合同生效日)至2017<br>年06月30日 |            |
|------------------|--|------------|
|                  | 期末余额                                       | 当期利息收入     |
| 中国工商银行股份有限公司活期存款 | 15,786,060.33                              | 318,158.00 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末(2017年06月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

| 6.4.9.1.1 受限证券类别:股票 |    |    |    |    |    |    |    |    |    |    |
|---------------------|----|----|----|----|----|----|----|----|----|----|
| 代码                  | 名称 | 成功 | 可流 | 流通 | 认购 | 期末 | 数量 | 期末 | 期末 | 说明 |

|        |      | 认购日        | 通日         | 受限类型   | 价格    | 估值单价  |       | 成本总额      | 估值总额      |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 002879 | 长缆科技 | 2017-06-05 | 2017-07-07 | 新发流通受限 | 18.02 | 18.02 | 1,313 | 23,660.26 | 23,660.26 | - |
| 002882 | 金龙羽  | 2017-06-15 | 2017-07-17 | 新发流通受限 | 6.20  | 6.20  | 2,966 | 18,389.20 | 18,389.20 | - |
| 603933 | 睿能科技 | 2017-06-28 | 2017-07-06 | 新发流通受限 | 20.20 | 20.20 | 857   | 17,311.40 | 17,311.40 | - |
| 603305 | 旭升股份 | 2017-06-30 | 2017-07-10 | 新发流通受限 | 11.26 | 11.26 | 1,351 | 15,212.26 | 15,212.26 | - |
| 300670 | 大烨智能 | 2017-06-26 | 2017-07-03 | 新发流通受限 | 10.93 | 10.93 | 1,259 | 13,760.87 | 13,760.87 | - |
| 300672 | 国科微  | 2017-06-30 | 2017-07-12 | 新发流通受限 | 8.48  | 8.48  | 1,257 | 10,659.36 | 10,659.36 | - |
| 603331 | 百达精工 | 2017-06-27 | 2017-07-05 | 新发流通受限 | 9.63  | 9.63  | 999   | 9,620.37  | 9,620.37  | - |
| 300671 | 富满电子 | 2017-06-27 | 2017-07-05 | 新发流通受限 | 8.11  | 8.11  | 942   | 7,639.62  | 7,639.62  | - |
| 603617 | 君禾股份 | 2017-06-23 | 2017-07-03 | 新发流通受限 | 8.93  | 8.93  | 832   | 7,429.76  | 7,429.76  | - |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 停牌 | 停牌 | 期末 | 复牌 | 复牌 | 数量 | 期末 | 期末 | 备注 |
|----|----|----|----|----|----|----|----|----|----|----|
|----|----|----|----|----|----|----|----|----|----|----|



|        |      | 日期         | 原因     | 估值<br>单价 | 日期         | 开盘<br>单价 |         | 成本<br>总额     | 估值<br>总额     | 说明 |
|--------|------|------------|--------|----------|------------|----------|---------|--------------|--------------|----|
| 601088 | 中国神华 | 2017-06-05 | 重大事项停牌 | 22.29    | -          | -        | 294,114 | 6,091,782.72 | 6,555,801.06 | -  |
| 002252 | 上海莱士 | 2017-04-21 | 重大事项停牌 | 20.24    | -          | -        | 130,900 | 2,628,940.01 | 2,649,416.00 | -  |
| 600643 | 爱建集团 | 2017-04-17 | 重大事项停牌 | 14.98    | 2017-08-02 | 16.48    | 97,900  | 1,326,501.00 | 1,466,542.00 | -  |
| 002013 | 中航机电 | 2017-05-12 | 重大事项停牌 | 10.33    | 2017-08-02 | 11.36    | 52,200  | 531,941.00   | 539,226.00   | -  |
| 002399 | 海普瑞  | 2017-04-28 | 重大事项停牌 | 20.23    | -          | -        | 20,000  | 410,635.00   | 404,600.00   | -  |
| 300291 | 华录百纳 | 2017-04-19 | 重大事项停牌 | 20.02    | -          | -        | 18,400  | 375,014.20   | 368,368.00   | -  |
| 600666 | 奥瑞德  | 2017-04-27 | 重大事项停牌 | 17.40    | -          | -        | 18,400  | 319,879.45   | 320,160.00   | -  |
| 002122 | 天马股份 | 2017-04-24 | 重大事项停牌 | 10.30    | 2017-07-24 | 11.15    | 28,000  | 286,900.00   | 288,400.00   | -  |
| 000099 | 中信海直 | 2017-05-04 | 重大事项停牌 | 11.26    | -          | -        | 22,900  | 256,218.00   | 257,854.00   | -  |
| 300252 | 金信诺  | 2017-04-27 | 重大事项停牌 | 21.65    | 2017-07-27 | 19.49    | 11,373  | 298,373.12   | 246,225.45   | -  |
| 00050  | 海虹   | 2017-      | 重大     | 24.93    | -          | -        | 8,800   | 272,0        | 219,3        | -  |

|        |          |                |                |       |   |   |            |                |                |   |
|--------|----------|----------------|----------------|-------|---|---|------------|----------------|----------------|---|
| 3      | 控股       | 05-11          | 事项<br>停牌       |       |   |   |            | 33.00          | 84.00          |   |
| 002143 | 印纪<br>传媒 | 2017-<br>04-18 | 重大<br>事项<br>停牌 | 24.93 | - | - | 7,200      | 253,7<br>72.00 | 179,4<br>96.00 | - |
| 002586 | 围海<br>股份 | 2017-<br>04-18 | 重大<br>事项<br>停牌 | 9.87  | - | - | 15,80<br>0 | 162,8<br>98.00 | 155,9<br>46.00 | - |
| 002650 | 加加<br>食品 | 2017-<br>04-20 | 重大<br>事项<br>停牌 | 5.88  | - | - | 7,000      | 48,98<br>6.39  | 41,16<br>0.00  | - |

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2017年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为569,286,093.87元，属于第二层次的余额为43,477,261.61元，无属于第三层次的余额。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 583,102,355.48 | 86.88         |
|    | 其中：股票             | 583,102,355.48 | 86.88         |
| 2  | 固定收益投资            | 29,661,000.00  | 4.42          |
|    | 其中：债券             | 29,661,000.00  | 4.42          |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |

|   |              |                |        |
|---|--------------|----------------|--------|
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 57,717,108.56  | 8.60   |
| 7 | 其他各项资产       | 639,302.69     | 0.10   |
| 8 | 合计           | 671,119,766.73 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | 20,316,352.79  | 3.09         |
| C  | 制造业              | 226,748,361.04 | 34.50        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 18,799,311.65  | 2.86         |
| E  | 建筑业              | 26,708,186.00  | 4.06         |
| F  | 批发和零售业           | 22,533,630.74  | 3.43         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 19,212,542.00  | 2.92         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 16,012,946.21  | 2.44         |
| J  | 金融业              | 189,455,453.55 | 28.82        |
| K  | 房地产业             | 19,079,804.00  | 2.90         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,601,701.00   | 0.55         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 13,105,916.50  | 1.99         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 7,528,150.00   | 1.15         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 583,102,355.48 | 88.71        |

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 601318 | 中国平安  | 712,406   | 35,342,461.66 | 5.38         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 63,675    | 30,045,048.75 | 4.57         |
| 3  | 000651 | 格力电器  | 666,500   | 27,439,805.00 | 4.17         |
| 4  | 601668 | 中国建筑  | 2,743,000 | 26,552,240.00 | 4.04         |
| 5  | 000725 | 京东方 A | 5,268,600 | 21,917,376.00 | 3.33         |
| 6  | 000776 | 广发证券  | 1,150,800 | 19,851,300.00 | 3.02         |
| 7  | 601006 | 大秦铁路  | 2,259,200 | 18,954,688.00 | 2.88         |
| 8  | 600104 | 上汽集团  | 572,529   | 17,777,025.45 | 2.70         |
| 9  | 600585 | 海螺水泥  | 759,600   | 17,265,708.00 | 2.63         |
| 10 | 000069 | 华侨城 A | 1,302,775 | 13,105,916.50 | 1.99         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com) 网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 80,733,475.37 | 12.28          |
| 2  | 601628 | 中国人寿 | 62,645,712.84 | 9.53           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 3  | 601668 | 中国建筑  | 53,082,757.48 | 8.08 |
| 4  | 600104 | 上汽集团  | 52,293,766.99 | 7.96 |
| 5  | 600519 | 贵州茅台  | 47,407,944.85 | 7.21 |
| 6  | 600030 | 中信证券  | 46,612,482.38 | 7.09 |
| 7  | 601006 | 大秦铁路  | 44,589,604.30 | 6.78 |
| 8  | 000651 | 格力电器  | 44,487,348.86 | 6.77 |
| 9  | 000725 | 京东方 A | 43,784,154.00 | 6.66 |
| 10 | 000776 | 广发证券  | 40,108,023.11 | 6.10 |
| 11 | 600016 | 民生银行  | 35,505,467.80 | 5.40 |
| 12 | 601166 | 兴业银行  | 32,694,984.00 | 4.97 |
| 13 | 600036 | 招商银行  | 32,547,187.40 | 4.95 |
| 14 | 601328 | 交通银行  | 30,479,967.00 | 4.64 |
| 15 | 000069 | 华侨城 A | 28,031,275.02 | 4.26 |
| 16 | 601088 | 中国神华  | 26,474,754.86 | 4.03 |
| 17 | 600028 | 中国石化  | 24,995,627.19 | 3.80 |
| 18 | 000425 | 徐工机械  | 24,456,802.00 | 3.72 |
| 19 | 600637 | 东方明珠  | 24,284,818.83 | 3.69 |
| 20 | 600585 | 海螺水泥  | 23,440,104.17 | 3.57 |
| 21 | 601288 | 农业银行  | 23,410,210.00 | 3.56 |
| 22 | 600999 | 招商证券  | 23,363,765.22 | 3.55 |
| 23 | 600000 | 浦发银行  | 21,938,034.69 | 3.34 |
| 24 | 000002 | 万科 A  | 21,650,959.59 | 3.29 |
| 25 | 000028 | 国药一致  | 19,299,899.48 | 2.94 |
| 26 | 000060 | 中金岭南  | 18,959,944.76 | 2.88 |
| 27 | 600048 | 保利地产  | 18,215,980.99 | 2.77 |
| 28 | 000157 | 中联重科  | 17,759,875.70 | 2.70 |
| 29 | 600309 | 万华化学  | 17,694,096.20 | 2.69 |
| 30 | 601169 | 北京银行  | 17,396,648.15 | 2.65 |
| 31 | 601225 | 陕西煤业  | 17,269,267.16 | 2.63 |
| 32 | 601899 | 紫金矿业  | 16,251,789.00 | 2.47 |
| 33 | 000685 | 中山公用  | 15,967,025.04 | 2.43 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 34 | 000078 | 海王生物 | 15,134,710.77 | 2.30 |
| 35 | 000938 | 紫光股份 | 15,043,709.15 | 2.29 |
| 36 | 000738 | 航发控制 | 14,864,962.24 | 2.26 |
| 37 | 002736 | 国信证券 | 14,466,652.01 | 2.20 |
| 38 | 002202 | 金风科技 | 14,235,259.00 | 2.17 |
| 39 | 600019 | 宝钢股份 | 14,097,523.40 | 2.14 |
| 40 | 601857 | 中国石油 | 14,060,074.69 | 2.14 |
| 41 | 002152 | 广电运通 | 13,981,091.70 | 2.13 |
| 42 | 601988 | 中国银行 | 13,973,065.00 | 2.13 |
| 43 | 600900 | 长江电力 | 13,604,845.23 | 2.07 |
| 44 | 000063 | 中兴通讯 | 13,406,824.80 | 2.04 |

注:本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601628 | 中国人寿 | 57,842,482.19 | 8.80           |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 46,980,109.48 | 7.15           |
| 3  | 600030 | 中信证券 | 39,264,426.67 | 5.97           |
| 4  | 600104 | 上汽集团 | 37,008,892.11 | 5.63           |
| 5  | 601668 | 中国建筑 | 27,491,707.52 | 4.18           |
| 6  | 601006 | 大秦铁路 | 26,212,295.14 | 3.99           |
| 7  | 600016 | 民生银行 | 24,120,933.80 | 3.67           |
| 8  | 000725 | 京东方A | 23,750,726.00 | 3.61           |
| 9  | 600999 | 招商证券 | 23,455,242.84 | 3.57           |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 22,631,852.63 | 3.44           |
| 11 | 000002 | 万科A  | 21,308,514.12 | 3.24           |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 21,199,390.00 | 3.23           |
| 13 | 601166 | 兴业银行 | 21,180,282.40 | 3.22           |
| 14 | 000776 | 广发证券 | 20,878,106.60 | 3.18           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 15 | 601088 | 中国神华  | 20,840,633.46 | 3.17 |
| 16 | 601328 | 交通银行  | 20,733,138.99 | 3.15 |
| 17 | 000425 | 徐工机械  | 19,370,749.00 | 2.95 |
| 18 | 600519 | 贵州茅台  | 19,178,656.70 | 2.92 |
| 19 | 600048 | 保利地产  | 18,012,027.62 | 2.74 |
| 20 | 601225 | 陕西煤业  | 17,702,630.57 | 2.69 |
| 21 | 600309 | 万华化学  | 17,525,372.94 | 2.67 |
| 22 | 000069 | 华侨城 A | 17,352,170.00 | 2.64 |
| 23 | 600028 | 中国石化  | 16,593,605.12 | 2.52 |
| 24 | 000028 | 国药一致  | 16,403,059.00 | 2.50 |
| 25 | 000060 | 中金岭南  | 16,162,977.56 | 2.46 |
| 26 | 601288 | 农业银行  | 15,869,619.00 | 2.41 |
| 27 | 600900 | 长江电力  | 13,930,294.85 | 2.12 |
| 28 | 600000 | 浦发银行  | 13,777,643.00 | 2.10 |
| 29 | 601857 | 中国石油  | 13,551,572.00 | 2.06 |
| 30 | 000938 | 紫光股份  | 13,219,374.59 | 2.01 |

注:本期累计卖出金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本(成交)总额 | 2,205,745,545.58 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 1,641,303,721.99 |

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -    | -            |
| 2  | 央行票据      | -    | -            |
| 3  | 金融债券      | -    | -            |
|    | 其中:政策性金融债 | -    | -            |



|    |         |               |      |
|----|---------|---------------|------|
| 4  | 企业债券    | -             | -    |
| 5  | 企业短期融资券 | -             | -    |
| 6  | 中期票据    | -             | -    |
| 7  | 可转债     | -             | -    |
| 8  | 同业存单    | 29,661,000.00 | 4.51 |
| 9  | 其他      | -             | -    |
| 10 | 合计      | 29,661,000.00 | 4.51 |

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 111798504 | 17厦门国际银行CD065 | 300,000 | 29,661,000.00 | 4.51         |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称 | 持仓量 | 合约市值 | 公允价值变动 | 风险说明          |
|-------------------|----|-----|------|--------|---------------|
| -                 | -  | -   | -    | -      | 符合本基金的收益风险特征  |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |     |      |        | -             |
| 股指期货投资本期收益（元）     |    |     |      |        | -2,725,440.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |    |     |      |        | -             |

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的，包括多头套保和空头套保。本报告期进行了少量的多头套保。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 广发证券股份有限公司（下称“广发证券”，股票代码：000776）于2016年11月收到中国证监会的行政处罚决定书。处罚原因是：在2015年7月12日证监会发布《关于清理整顿违法从事证券业务活动的意见》（证监会公告[2015]19号）之后，广发证券仍未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，新增下挂子账户99个

本基金投研人员分析认为，广发证券在接受处罚之后，公司经营情况正常；该事件对公司经营并无重大影响。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对广发证券进行了投资。

7.12.2 本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 468,707.66 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 169,859.61 |
| 5  | 应收申购款   | 735.42     |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 639,302.69 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5.1 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别        | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额  | 持有人结构         |           |                |           |
|-------------|----------|------------|---------------|-----------|----------------|-----------|
|             |          |            | 机构投资者         |           | 个人投资者          |           |
|             |          |            | 持有份额          | 占总份额比例(%) | 持有份额           | 占总份额比例(%) |
| 创金合信量化核心混合A | 2,274    | 111,199.48 | -             | -         | 252,867,627.16 | 100.00    |
| 创金合信量化核心混合C | 2,625    | 148,105.94 | 30,529,837.10 | 7.85      | 358,248,254.52 | 92.15     |
| 合计          | 4,849    | 132,325.37 | 30,529,837.10 | 4.76      | 611,115,881.68 | 95.24     |

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别        | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例(%) |
|------------------|-------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 创金合信量化核心混合A | 83,875.22 | 0.03        |

|  |             |            |      |
|--|-------------|------------|------|
|  | 创金合信量化核心混合C | 68,001.75  | 0.02 |
|  | 合计          | 151,876.97 | 0.02 |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别        | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 创金合信量化核心混合A | 0~10              |
|                                | 创金合信量化核心混合C | 0.00              |
|                                | 合计          | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 创金合信量化核心混合A | 0.00              |
|                                | 创金合信量化核心混合C | 0.00              |
|                                | 合计          | -                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    | 创金合信量化核心混合A    | 创金合信量化核心混合C    |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2017年03月27日)基金份额总额         | 269,241,417.75 | 532,756,314.04 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 204,735.12     | 30,285,543.67  |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 16,578,525.71  | 174,263,766.09 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 252,867,627.16 | 388,778,091.62 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易           |                | 应支付该券商的佣金  |               | 备注 |
|--------|--------|----------------|----------------|------------|---------------|----|
|        |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额比例(%) | 佣金         | 占当期佣金总量的比例(%) |    |
| 天风证券   | 2      | 898,292,958.62 | 23.36          | 287,853.63 | 19.58         | -  |
| 第一创业证券 | 2      | -              | 0.00           | -          | 0.00          | -  |
| 金元证券   | 2      | 321,321,692.65 | 8.35           | 72,298.70  | 4.92          | -  |

|        |   |                  |       |              |       |   |
|--------|---|------------------|-------|--------------|-------|---|
| 招商证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 兴业证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 国信证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 广发证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 申万宏源   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 银河证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 中信建投证券 | 2 | 2,626,318,315.53 | 68.29 | 1,109,675.29 | 75.50 | - |
| 东兴证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 中泰证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 中信证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 长江证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 中银国际证券 | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 华泰证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 中投证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 华安证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |
| 安信证券   | 2 | -                | 0.00  | -            | 0.00  | - |

注:交易单元的选择标准和程序:

(1) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为基金提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告;

(2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

(3) 经营行为规范,内部管理规范、严格,具备健全的内部控制制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需,并能为基金提供全面的信息服。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元,并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金在报告期内成立,交易单元均于本期内新增。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 | 基金交易 |
|------|------|--------|------|------|
|------|------|--------|------|------|

|        | 成交金额 | 占当期债券成交总量的比例 (%) | 成交金额              | 占当期债券回购交易成交总量的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证交易成交总量的比例 (%) | 成交金额 | 占当期基金交易成交总量的比例 (%) |
|--------|------|------------------|-------------------|----------------------|------|--------------------|------|--------------------|
| 天风证券   | -    | -                | 283,000,000.00    | 2.29                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 第一创业证券 | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 金元证券   | -    | -                | 1,285,000,000.00  | 10.40                | -    | -                  | -    | -                  |
| 招商证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 兴业证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 国信证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 广发证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 申万宏源   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 银河证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 中信建投证券 | -    | -                | 10,789,000,000.00 | 87.31                | -    | -                  | -    | -                  |
| 东兴证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 中泰证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 中信证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 长江证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 中银国际证券 | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 华泰证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 中投证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |
| 华安证券   | -    | -                | -                 | 0.00                 | -    | -                  | -    | -                  |

|      |   |   |   |      |   |   |   |   |
|------|---|---|---|------|---|---|---|---|
| 安信证券 | - | - | - | 0.00 | - | - | - | - |
|------|---|---|---|------|---|---|---|---|

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

创金合信基金管理有限公司  
二〇一七年八月二十五日