

---

# 创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金

## 2018 年半年度报告

2018 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

送出日期:2018 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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2018年8月28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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
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	69
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	69
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	69
§8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71

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 .....	71
§9 开放式基金份额变动 .....	72
§10 重大事件揭示 .....	72
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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 .....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
10.4 基金投资策略的改变 .....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
10.8 其他重大事件 .....	77
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	79
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
§12 备查文件目录 .....	79
12.1 备查文件目录 .....	80
12.2 存放地点 .....	80
12.3 查阅方式 .....	80

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	创金合信量化发现混合	
基金主代码	003241	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年09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	523,692,845.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信量化发现混合A	创金合信量化发现混合C
下属分级基金的交易代码	003241	003242
报告期末下属分级基金的份额总额	357,068,285.15份	166,624,560.49份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用数量化投资模型指导资产配置和股票选择决策，力争持续获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的方式，以宏观经济数据、上市公司相关数据、资本/资金市场相关数据为研究与分析对象，建立数量化投资模型，指导资产配置和股票选择决策。一方面，本基金基于对资本市场参与主体行为趋势的研究，从“自上而下”的角度进行资产配置；另一方面，本基金采用量化选股模型，从与上市公司相关的数据中发现有价值的信息，以“自下而上”的视角精选股票投资组合。
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%+银行人民币活期存款利率（税后）×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货币市场基金、债券型基金，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	010-66105799
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址	深圳市福田区福华一路15号投行大厦15层	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码	518000	100140
法定代表人	刘学民	易会满

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	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(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	创金合信量化发现混合A	创金合信量化发现混合C
本期已实现收益	-34,093,405.35	-16,124,638.39
本期利润	-40,271,462.31	-18,882,838.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0976	-0.1041
本期加权平均净值利润率	-10.66%	-11.53%
本期基金份额净值增长率	-11.64%	-11.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-60,586,859.76	-30,310,240.47
期末可供分配基金份额利润	-0.1697	-0.1819
期末基金资产净值	296,481,425.39	136,314,320.02
期末基金份额净值	0.8303	0.8181
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-16.97%	-18.19%

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. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 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

## 创金合信量化发现混合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	-7.72%	1.53%	-7.18%	1.46%	-0.54%	0.07%
过去三个月	-10.04%	1.16%	-10.36%	0.99%	0.32%	0.17%
过去六个月	-11.64%	1.18%	-11.26%	0.95%	-0.38%	0.23%
过去一年	-9.09%	0.96%	-9.89%	0.78%	0.80%	0.18%
自基金合同生效起至今	-16.97%	0.85%	-10.22%	0.68%	-6.75%	0.17%

## 创金合信量化发现混合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	-7.78%	1.53%	-7.18%	1.46%	-0.60%	0.07%
过去三个月	-10.23%	1.16%	-10.36%	0.99%	0.13%	0.17%
过去六个月	-11.99%	1.18%	-11.26%	0.95%	-0.73%	0.23%
过去一年	-9.81%	0.96%	-9.89%	0.78%	0.08%	0.18%
自基金合同生效起至今	-18.19%	0.85%	-10.22%	0.68%	-7.97%	0.17%



效起至 今						
----------	--	--	--	--	--	--

### 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





注：自 2018 年 6 月 11 日起，本基金的业绩比较基准由原来的“中证 500 指数收益率×60%+一年期人民币定期存款利率（税后）×40%”变更为“中证 500 指数收益率×80%+银行人民币活期存款利率（税后）×20%”。上述事项已于 2018 年 6 月 7 日在指定媒体上公告。

## § 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11只公募基金。截至2018年6月30日，本公司共管理39只公募基金，其中混合型产品14只、指数型产品8只、债券型产品10只、股票型产品6只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约147.33亿元。

#### 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（助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日 期	离任日 期		
程志田	本基金 基金经 理、量 化投资 部总监	2016-09 -27	-	11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日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共46次，该基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，未对当天的股票价格产生冲击。

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2018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，量化选股模型提供了选股依据；另一方面，仓位管理上我们严格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

截至报告期末创金合信量化发现混合A基金份额净值为0.8303元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.64%，同期业绩比较基准收益率为-11.26%；截至报告期末创金合信量化发现混合C基金份额净值为0.8181元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.99%，同期业绩比较基准收益率为-11.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年，在去杠杆的大环境下，市场有所动荡，主流的指数均有所调整。边际上看，宏观经济仍处于复苏阶段，经济增速没有太大的风险；随着去杠杆取得一定成效，流动性边际上有所改善，对股市有一定的利好；估值的角度来看，以中证500和中证1000为代表的中小盘风格指数的估值处于历史底部位置，沪深300为代表的大盘蓝筹风格指数也处于估值偏低的位置，股票市场整体具备估值吸引力。在投资管理上，我们坚持严格采用量化模型进行投资运作。

#### 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、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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，本基金托管人在对创金合信量化发现灵活配置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》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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，创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金的管理人——创金合信基金管理有限公司在创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 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：创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	35,098,908.01	46,307,172.15
结算备付金		59,431,545.52	64,505,632.43
存出保证金		8,068,801.91	9,431,470.88
交易性金融资产	6.4.7.2	333,515,573.99	533,347,514.60
其中：股票投资		322,550,925.99	531,697,815.40
基金投资		-	-
债券投资		10,964,648.00	1,649,699.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,681,708.61	3,670,609.12
应收利息	6.4.7.5	343,891.55	28,556.55
应收股利		-	-
应收申购款		7,069.19	12,266.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		439,147,498.78	657,303,222.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年06月30日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,352,047.51	7,856,201.84
应付赎回款		414,513.25	677,287.61
应付管理人报酬		561,297.49	845,566.82
应付托管费		93,549.58	140,927.81
应付销售服务费		94,028.33	133,722.50
应付交易费用	6.4.7.7	1,738,057.06	1,944,091.07
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,260.15	209,000.00
负债合计		6,351,753.37	11,806,797.65
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	523,692,845.64	689,146,076.84
未分配利润	6.4.7.1 0	-90,897,100.23	-43,649,652.08
所有者权益合计		432,795,745.41	645,496,424.76
负债和所有者权益总计		439,147,498.78	657,303,222.41

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额总额523,692,845.64份，其中下属A类基金份额357,068,285.15份，C类基金份额166,624,560.49份。下属A类基金份额净值0.8303元，C类基金份额净值0.8181元。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		-43,331,664.59	-66,026,406.02

1. 利息收入		774,985.30	2,248,493.10
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	711,602.19	434,984.15
债券利息收入		63,383.11	586,520.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,226,988.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-35,201,561.13	-112,657,022.04
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-36,697,324.33	-108,197,734.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	48,586.82	65,264.31
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-1,081,700.39	-9,867,480.00
股利收益	6.4.7.1 5	2,528,876.77	5,342,928.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-8,936,256.98	44,008,306.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	31,168.22	373,816.46
<b>减：二、费用</b>		15,822,636.13	22,612,819.52
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	4,027,376.95	8,057,005.38



2. 托管费	6.4.10.2.2	671,229.52	1,342,834.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	648,914.51	1,527,936.63
4. 交易费用	6.4.7.18	10,363,987.32	11,575,476.80
5. 利息支出		918.25	723.54
其中：卖出回购金融资产支出		918.25	723.54
6. 税金及附加		2,009.12	-
7. 其他费用	6.4.7.19	108,200.46	108,842.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-59,154,300.72	-88,639,225.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-59,154,300.72	-88,639,225.54

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018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)	689,146,076.84	-43,649,652.08	645,496,424.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-59,154,300.72	-59,154,300.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	-165,453,231.20	11,906,852.57	-153,546,378.63

少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	17,342,168.51	-1,196,670.47	16,145,498.04
2. 基金赎回款	-182,795,399.71	13,103,523.04	-169,691,876.67
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）	523,692,845.64	-90,897,100.23	432,795,745.41
项 目	上年度可比期间 2017年01月01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）	1,307,963,127.28	-13,346,025.34	1,294,617,101.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-88,639,225.54	-88,639,225.54
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）	-323,003,383.76	14,487,108.59	-308,516,275.17
其中：1. 基金申购款	32,286,297.16	-1,047,395.80	31,238,901.36
2. 基金赎回款	-355,289,680.92	15,534,504.39	-339,755,176.53
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）	984,959,743.52	-87,498,142.29	897,461,601.23

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

创金合信量化发现灵活配置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[2016]1878号《关于准予创金合信量化发现灵活配置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《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信量化发现灵活配置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1,511,939,991.40元,业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(2016)第1257号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,512,800,086.21份基金份额,其中认购资金利息折合860,094.81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《创金合信量化发现灵活配置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、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、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(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。自基金合同生效日至2018年6月10日止期间,本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率×60%+一年期人民币定期存款利率(税后)×40%。根据本基金的基金管理人于2018年6月7日发布的《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》,自2018年6月11日起,本基金的业绩

比较基准变更为：中证500指数收益率×80%+银行人民币活期存款利率（税后）×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》、《创金合信量化发现灵活配置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。

#### 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 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 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2018年06月30日
活期存款	35,098,908.01
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	35,098,908.01

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	332,339,626.34	322,550,925.99	-9,788,700.35
贵金属投资-金	-	-	-

交所黄金合约				
债券	交易所市场	10,966,384.00	10,964,648.00	-1,736.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,966,384.00	10,964,648.00	-1,736.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		343,306,010.34	333,515,573.99	-9,790,436.35

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	38,063,840.00	-	-	-
股指期货	38,063,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	38,063,840.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应收活期存款利息	5,836.96
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	26,496.29
应收债券利息	311,443.20
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	115.10
合计	343,891.55

## 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	1,738,057.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,738,057.06

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
预提费用	98,260.15
合计	98,260.15

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 创金合信量化发现混合A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信量化发现混合A)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	481,598,548.49	481,598,548.49
本期申购	13,587,502.99	13,587,502.99
本期赎回(以“-”号填列)	-138,117,766.33	-138,117,766.33
本期末	357,068,285.15	357,068,285.15

##### 6.4.7.9.2 创金合信量化发现混合C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信量化发现混合C)	本期2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	207,547,528.35	207,547,528.35
本期申购	3,754,665.52	3,754,665.52
本期赎回(以“-”号填列)	-44,677,633.38	-44,677,633.38
本期末	166,624,560.49	166,624,560.49

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 创金合信量化发现混合A

单位：人民币元

项目 (创金合信量化发现混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计



上年度末	-29,421,102.51	384,634.69	-29,036,467.82
本期利润	-34,093,405.35	-6,178,056.96	-40,271,462.31
本期基金份额交易产生的变动数	8,526,223.23	194,847.14	8,721,070.37
其中：基金申购款	-810,766.86	-5,281.66	-816,048.52
基金赎回款	9,336,990.09	200,128.80	9,537,118.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-54,988,284.63	-5,598,575.13	-60,586,859.76

## 6.4.7.10.2 创金合信量化发现混合C

单位：人民币元

项目 (创金合信量化发现混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-14,763,243.28	150,059.02	-14,613,184.26
本期利润	-16,124,638.39	-2,758,200.02	-18,882,838.41
本期基金份额交易产生的变动数	3,169,005.89	16,776.31	3,185,782.20
其中：基金申购款	-328,316.03	-52,305.92	-380,621.95
基金赎回款	3,497,321.92	69,082.23	3,566,404.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,718,875.78	-2,591,364.69	-30,310,240.47

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	116,592.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	592,224.46
其他	2,785.29
合计	711,602.19

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出股票成交总额	5,532,934,849.57
减：卖出股票成本总额	5,569,632,173.90
买卖股票差价收入	-36,697,324.33

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	48,586.82
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	48,586.82

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,603,001.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,552,200.00
减：应收利息总额	2,214.28
买卖债券差价收入	48,586.82

## 6.4.7.14 衍生工具收益

## 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2018年01月01日至2018年06月30日
期货投资	-1,064,976.00

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,528,876.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,528,876.77

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-8,886,936.98
——股票投资	-8,931,501.78
——债券投资	44,564.80
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-49,320.00
——权证投资	-
——期货投资	-49,320.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-8,936,256.98

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	31,164.08
转换费收入	4.14
合计	31,168.22

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	10,357,582.17
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	6,405.15
合计	10,363,987.32

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	49,588.57
汇划手续费	340.31
账户维护费	18,000.00
查询服务费	600.00
合计	108,200.46

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	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（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
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
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	399,233,599.26	3.66%	-	-

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券股份有限公司	128,240.35	3.32%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定, 以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,027,376.95	8,057,005.38
其中：支付销售机构的客户维护费	2,093,679.91	4,602,469.36

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	671,229.52	1,342,834.21

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3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。

## 6.4.10.2.3 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 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信量化发现混合A	创金合信量化发现混合C	合计
创金合信基金	0.00	149.75	149.75
第一创业证券	0.00	2,837.54	2,837.54
工商银行	0.00	352,654.78	352,654.78
合计	-	355,642.07	355,642.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信量化发现混合A	创金合信量化发现混合C	合计
创金合信基金	-	223,078.06	223,078.06
第一创业证券	-	11,461.72	11,461.72
工商银行	-	660,469.33	660,469.33
合计	-	895,009.11	895,009.11

本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额所代表的基金资产收取销售服务费。C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.80%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，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，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。



**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**6.4.10.4.2 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**

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.5 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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	35,098,908.01	116,592.44	44,235,905.40	240,924.75

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。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金**

本基金于本期未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新发流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项停牌	5.84	2018-07-17	5.26	612,600	3,644,182.60	3,577,584.00	-
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大事项停牌	6.00	-	-	404,000	2,312,416.80	2,424,000.00	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事项停牌	9.49	-	-	101,900	959,982.00	967,031.00	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大事项停牌	10.80	2018-08-07	9.63	72,000	830,072.17	777,600.00	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	86,500	641,031.00	646,155.00	-
300008	天海防务	2018-06-	重大事项	4.81	2018-07-	5.20	116,700	629,557.34	561,327.00	-

		19	停牌		03					
300187	永清环保	2018-04-09	重大事项停牌	9.32	-	-	53,600	515,686.94	499,552.00	-
600750	江中药业	2018-05-02	重大事项停牌	17.75	2018-08-01	16.12	24,468	428,296.12	434,307.00	-
600052	浙江广厦	2018-04-02	重大事项停牌	3.73	2018-07-30	3.90	90,700	325,481.36	338,311.00	-
603939	益丰药房	2018-04-17	重大事项停牌	59.72	2018-07-16	65.69	5,500	334,571.00	328,460.00	-
603636	南威软件	2018-05-29	重大事项停牌	10.00	-	-	30,900	315,920.19	309,000.00	-
002171	楚江新材	2018-06-07	重大事项停牌	6.78	-	-	44,100	290,486.95	298,998.00	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项停牌	32.50	-	-	8,900	291,728.00	289,250.00	-
600490	鹏欣资源	2018-04-16	重大事项停牌	8.67	-	-	19,000	168,603.91	164,730.00	-
600678	四川金顶	2018-04-18	重大事项停牌	10.24	-	-	15,900	163,953.90	162,816.00	-
300111	向日葵	2018-06-04	重大事项停牌	2.74	-	-	53,800	149,022.01	147,412.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	10,001,000.00	0.00
合计	10,001,000.00	0.00

未评级债券为期限一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券等债券。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	1,649,699.20

AAA以下	0.00	0.00
未评级	963,648.00	0.00
合计	963,648.00	1,649,699.20

未评级债券为期限一年以上的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券等债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2018年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理

部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2018年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为359,593,070.66元，超过经确认的当日净赎回金额。于2018年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为2.78%，未超过15%。

同时，本基金的基金管理人合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
----------------	------	------	------	-----	----

资产					
银行存款	35,098,908.01	-	-	-	35,098,908.01
结算备付金	59,431,545.52	-	-	-	59,431,545.52
存出保证金	8,068,801.91	-	-	-	8,068,801.91
交易性金融资产	10,964,648.00	-	-	322,550,925.99	333,515,573.99
应收证券清算款	-	-	-	2,681,708.61	2,681,708.61
应收利息	-	-	-	343,891.55	343,891.55
应收申购款	-	-	-	7,069.19	7,069.19
资产总计	113,563,903.44	-	-	325,583,595.34	439,147,498.78
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,352,047.51	3,352,047.51
应付赎回款	-	-	-	414,513.25	414,513.25
应付管理人报酬	-	-	-	561,297.49	561,297.49
应付托管费	-	-	-	93,549.58	93,549.58
应付销售服务费	-	-	-	94,028.33	94,028.33
应付交易费用	-	-	-	1,738,057.06	1,738,057.06
其他负债	-	-	-	98,260.15	98,260.15
负债总计	-	-	-	6,351,753.37	6,351,753.37

计					
利率敏 感度缺 口	113,563,903.44	-	-	319,231,841.97	432,795,745.41
上年度 末2017 年12月3 1日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存 款	46,307,172.15	-	-	-	46,307,172.15
结算备 付金	64,505,632.43	-	-	-	64,505,632.43
存出保 证金	9,431,470.88	-	-	-	9,431,470.88
交易性 金融资 产	-	1,649,699.20	-	531,697,815.40	533,347,514.60
应收证 券清算 款	-	-	-	3,670,609.12	3,670,609.12
应收利 息	-	-	-	28,556.55	28,556.55
应收申 购款	-	-	-	12,266.68	12,266.68
资产总 计	120,244,275.46	1,649,699.20	-	535,409,247.75	657,303,222.41
负债					
应付证 券清算 款	-	-	-	7,856,201.84	7,856,201.84
应付赎 回款	-	-	-	677,287.61	677,287.61
应付管 理人报 酬	-	-	-	845,566.82	845,566.82
应付托 管费	-	-	-	140,927.81	140,927.81



应付销售服务费	-	-	-	133,722.50	133,722.50
应付交易费用	-	-	-	1,944,091.07	1,944,091.07
其他负债	-	-	-	209,000.00	209,000.00
负债总计	-	-	-	11,806,797.65	11,806,797.65
利率敏感度缺口	120,244,275.46	1,649,699.20	-	523,602,450.10	645,496,424.76

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年6月30日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为4.88%(2017年12月31日:0.26%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日:同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用“自上而下”的策略,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例(%)	公允价值	占基金 资产净 值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	322,550,925.99	74.53	531,697,815.40	82.37
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	322,550,925.99	74.53	531,697,815.40	82.37

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	16,321,761.65	-
	比较基准下降5%资产净值变动	-16,321,761.65	-
	比较基准上涨5%资产净值变动	-	22,244,652.86
	比较基准下降5%资产净值变动	-	-22,244,652.86

	值变动		
--	-----	--	--

#### 6.4.14 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2018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310,536,362.84元，第二层次的余额为22,979,211.15元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次509,389,373.11元，第二层次23,958,141.49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。

##### (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2018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(2017年12月31日：同)。

##### (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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

(3) 除公允价值 and 增值税外，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	322,550,925.99	73.45
	其中：股票	322,550,925.99	73.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,964,648.00	2.50
	其中：债券	10,964,648.00	2.50
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	94,530,453.53	21.53
8	其他各项资产	11,101,471.26	2.53
9	合计	439,147,498.78	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	3,982,500.45	0.92
B	采矿业	11,864,284.10	2.74
C	制造业	173,282,693.98	40.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,940,459.85	1.60
E	建筑业	9,987,367.94	2.31
F	批发和零售业	18,773,110.60	4.34
G	交通运输、仓储和邮政业	11,911,491.99	2.75
H	住宿和餐饮业	250,436.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,741,994.80	6.18
J	金融业	12,709,022.96	2.94
K	房地产业	23,221,922.60	5.37
L	租赁和商务服务业	10,789,114.27	2.49
M	科学研究和技术服务业	1,177,283.15	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	2,465,485.14	0.57
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	5,236,579.06	1.21
S	综合	3,217,179.10	0.74
	合计	322,550,925.99	74.53

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600600	青岛啤酒	111,900	4,904,577.00	1.13
2	002078	太阳纸业	475,500	4,607,595.00	1.06

3	000415	渤海金控	612,600	3,577,584.00	0.83
4	000997	新大陆	223,700	3,523,275.00	0.81
5	600315	上海家化	86,000	3,408,180.00	0.79
6	000887	中鼎股份	236,500	3,407,965.00	0.79
7	000656	金科股份	709,400	3,405,120.00	0.79
8	000975	银泰资源	313,300	3,176,862.00	0.73
9	000703	恒逸石化	207,240	3,083,731.20	0.71
10	002440	闰土股份	252,650	2,953,478.50	0.68
11	000686	东北证券	455,300	2,918,473.00	0.67
12	002603	以岭药业	205,852	2,877,810.96	0.66
13	000418	小天鹅A	40,800	2,829,480.00	0.65
14	600729	重庆百货	85,300	2,810,635.00	0.65
15	000547	航天发展	346,100	2,703,041.00	0.62
16	600649	城投控股	432,400	2,646,288.00	0.61
17	600143	金发科技	487,698	2,545,783.56	0.59
18	002221	东华能源	258,000	2,520,660.00	0.58
19	600037	歌华有线	240,300	2,479,896.00	0.57
20	000581	威孚高科	110,800	2,449,788.00	0.57
21	000825	太钢不锈	404,000	2,424,000.00	0.56
22	600426	华鲁恒升	136,800	2,406,312.00	0.56
23	600201	生物股份	138,560	2,367,990.40	0.55
24	603589	口子窖	37,809	2,323,363.05	0.54
25	600823	世茂股份	551,000	2,303,180.00	0.53
26	600064	南京高科	309,800	2,273,932.00	0.53
27	600582	天地科技	610,800	2,241,636.00	0.52
28	000758	中色股份	492,900	2,218,050.00	0.51
29	600664	哈药股份	557,300	2,212,481.00	0.51
30	002299	圣农发展	142,305	2,204,304.45	0.51
31	000027	深圳能源	434,400	2,145,936.00	0.50
32	002233	塔牌集团	183,000	2,093,520.00	0.48
33	600557	康缘药业	164,850	2,035,897.50	0.47

34	002640	跨境通	133,000	1,997,660.00	0.46
35	600160	巨化股份	265,640	1,944,484.80	0.45
36	601717	郑煤机	333,917	1,940,057.77	0.45
37	000729	燕京啤酒	285,700	1,922,761.00	0.44
38	600256	广汇能源	467,890	1,913,670.10	0.44
39	002373	千方科技	142,800	1,863,540.00	0.43
40	002701	奥瑞金	340,100	1,856,946.00	0.43
41	603899	晨光文具	56,822	1,800,689.18	0.42
42	601928	凤凰传媒	292,148	1,776,259.84	0.41
43	600266	北京城建	184,300	1,732,420.00	0.40
44	300308	中际旭创	27,800	1,669,112.00	0.39
45	002400	省广集团	515,500	1,665,065.00	0.38
46	002093	国脉科技	211,200	1,628,352.00	0.38
47	002642	荣之联	171,100	1,572,409.00	0.36
48	000541	佛山照明	260,860	1,562,551.40	0.36
49	600500	中化国际	227,200	1,549,504.00	0.36
50	002064	华峰氨纶	374,700	1,547,511.00	0.36
51	300058	蓝色光标	271,300	1,546,410.00	0.36
52	002022	科华生物	129,600	1,535,760.00	0.35
53	000028	国药一致	30,600	1,526,940.00	0.35
54	300297	蓝盾股份	183,000	1,484,130.00	0.34
55	002127	南极电商	156,729	1,471,685.31	0.34
56	002663	普邦股份	493,600	1,465,992.00	0.34
57	600639	浦东金桥	117,200	1,462,656.00	0.34
58	000031	中粮地产	247,000	1,427,660.00	0.33
59	000937	冀中能源	343,800	1,413,018.00	0.33
60	002261	拓维信息	306,700	1,410,820.00	0.33
61	600260	凯乐科技	52,100	1,398,364.00	0.32
62	000592	平潭发展	490,500	1,393,020.00	0.32
63	600611	大众交通	349,700	1,391,806.00	0.32
64	000009	中国宝安	274,635	1,345,711.50	0.31

65	000848	承德露露	127,013	1,345,067.67	0.31
66	600511	国药股份	48,300	1,301,685.00	0.30
67	600056	中国医药	71,200	1,300,824.00	0.30
68	600017	日照港	401,900	1,290,099.00	0.30
69	002056	横店东磁	178,376	1,250,415.76	0.29
70	300257	开山股份	79,400	1,214,026.00	0.28
71	600098	广州发展	186,300	1,201,635.00	0.28
72	002399	海普瑞	53,300	1,180,062.00	0.27
73	600640	号百控股	113,900	1,158,363.00	0.27
74	002588	史丹利	218,600	1,132,348.00	0.26
75	000528	柳工	104,700	1,121,337.00	0.26
76	002244	滨江集团	213,200	1,108,640.00	0.26
77	002463	沪电股份	285,600	1,068,144.00	0.25
78	600270	外运发展	50,700	1,062,672.00	0.25
79	600565	迪马股份	353,900	1,044,005.00	0.24
80	000969	安泰科技	157,100	981,875.00	0.23
81	002353	杰瑞股份	60,400	981,500.00	0.23
82	600970	中材国际	145,052	968,947.36	0.22
83	300324	旋极信息	101,900	967,031.00	0.22
84	600872	中炬高新	33,600	940,800.00	0.22
85	002375	亚厦股份	174,400	931,296.00	0.22
86	600058	五矿发展	111,600	927,396.00	0.21
87	600757	长江传媒	160,100	910,969.00	0.21
88	001696	宗申动力	184,700	905,030.00	0.21
89	300159	新研股份	126,500	895,620.00	0.21
90	002317	众生药业	83,800	885,766.00	0.20
91	002250	联化科技	96,500	851,130.00	0.20
92	300113	顺网科技	47,400	825,234.00	0.19
93	600350	山东高速	196,000	793,800.00	0.18
94	300118	东方日升	72,000	777,600.00	0.18
95	000066	中国长城	108,400	770,724.00	0.18



96	601168	西部矿业	119,900	752,972.00	0.17
97	002268	卫士通	34,000	742,220.00	0.17
98	601311	骆驼股份	62,000	711,140.00	0.16
99	000999	华润三九	25,500	709,665.00	0.16
100	300315	掌趣科技	169,000	706,420.00	0.16
101	002195	二三四五	164,120	702,433.60	0.16
102	002251	步步高	59,200	673,696.00	0.16
103	600282	南钢股份	152,100	672,282.00	0.16
104	000778	新兴铸管	154,800	662,544.00	0.15
105	300427	红相股份	45,636	657,158.40	0.15
106	601390	中国中铁	86,500	646,155.00	0.15
107	002422	科伦药业	20,100	645,210.00	0.15
108	002482	广田集团	107,700	642,969.00	0.15
109	300121	阳谷华泰	45,800	642,574.00	0.15
110	300039	上海凯宝	110,000	638,000.00	0.15
111	300296	利亚德	49,300	634,984.00	0.15
112	300346	南大光电	48,700	634,561.00	0.15
113	300150	世纪瑞尔	131,100	633,213.00	0.15
114	002217	合力泰	76,700	632,775.00	0.15
115	300351	永贵电器	50,400	631,512.00	0.15
116	000069	华侨城 A	87,200	630,456.00	0.15
117	002298	中电兴发	89,000	628,340.00	0.15
118	300200	高盟新材	75,700	628,310.00	0.15
119	002402	和而泰	75,700	628,310.00	0.15
120	002415	海康威视	16,900	627,497.00	0.14
121	000651	格力电器	13,300	627,095.00	0.14
122	600805	悦达投资	122,940	626,994.00	0.14
123	000333	美的集团	12,000	626,640.00	0.14
124	300292	吴通控股	171,200	626,592.00	0.14
125	600585	海螺水泥	18,700	626,076.00	0.14
126	600602	云赛智联	107,900	625,820.00	0.14

127	002484	江海股份	95,600	625,224.00	0.14
128	000058	深赛格	122,100	625,152.00	0.14
129	000631	顺发恒业	182,200	624,946.00	0.14
130	600676	交运股份	125,600	624,232.00	0.14
131	000548	湖南投资	142,500	624,150.00	0.14
132	000858	五粮液	8,200	623,200.00	0.14
133	300442	普丽盛	37,200	623,100.00	0.14
134	600104	上汽集团	17,800	622,822.00	0.14
135	600887	伊利股份	22,300	622,170.00	0.14
136	002654	万润科技	113,300	622,017.00	0.14
137	002406	远东传动	113,300	622,017.00	0.14
138	600831	广电网络	103,300	621,866.00	0.14
139	300438	鹏辉能源	32,200	621,782.00	0.14
140	002144	宏达高科	55,600	621,052.00	0.14
141	601318	中国平安	10,600	620,948.00	0.14
142	002687	乔治白	115,600	620,772.00	0.14
143	002391	长青股份	48,500	619,830.00	0.14
144	000719	中原传媒	92,638	619,748.22	0.14
145	002393	力生制药	25,300	619,344.00	0.14
146	601333	广深铁路	145,600	618,800.00	0.14
147	300182	捷成股份	81,600	618,528.00	0.14
148	002304	洋河股份	4,700	618,520.00	0.14
149	000965	天保基建	139,890	618,313.80	0.14
150	002311	海大集团	29,300	618,230.00	0.14
151	600820	隧道股份	104,500	617,595.00	0.14
152	600036	招商银行	23,350	617,374.00	0.14
153	002671	龙泉股份	138,400	617,264.00	0.14
154	002501	利源精制	99,500	616,900.00	0.14
155	002478	常宝股份	137,700	616,896.00	0.14
156	600153	建发股份	68,600	616,714.00	0.14
157	600491	龙元建设	88,100	615,819.00	0.14

158	000088	盐田港	93,400	615,506.00	0.14
159	600337	美克家居	105,000	615,300.00	0.14
160	000876	新希望	97,000	614,980.00	0.14
161	000568	泸州老窖	10,100	614,686.00	0.14
162	600019	宝钢股份	78,900	614,631.00	0.14
163	002454	松芝股份	104,700	614,589.00	0.14
164	002061	浙江交科	58,700	614,589.00	0.14
165	600705	中航资本	131,500	614,105.00	0.14
166	002255	海陆重工	118,500	613,830.00	0.14
167	601186	中国铁建	71,209	613,821.58	0.14
168	600061	国投资本	66,132	613,704.96	0.14
169	601898	中煤能源	127,000	613,410.00	0.14
170	601288	农业银行	178,300	613,352.00	0.14
171	002543	万和电气	31,745	613,313.40	0.14
172	300381	溢多利	70,400	613,184.00	0.14
173	601877	正泰电器	27,400	611,568.00	0.14
174	600016	民生银行	87,300	611,100.00	0.14
175	000883	湖北能源	148,600	610,746.00	0.14
176	002142	宁波银行	37,400	609,246.00	0.14
177	600000	浦发银行	63,700	608,972.00	0.14
178	601857	中国石油	78,500	605,235.00	0.14
179	002276	万马股份	103,300	603,272.00	0.14
180	002091	江苏国泰	94,900	602,615.00	0.14
181	002414	高德红外	43,900	590,016.00	0.14
182	600519	贵州茅台	800	585,168.00	0.14
183	600578	京能电力	183,800	573,456.00	0.13
184	600267	海正药业	39,300	571,422.00	0.13
185	300008	天海防务	116,700	561,327.00	0.13
186	000089	深圳机场	70,300	537,795.00	0.12
187	600216	浙江医药	40,600	518,462.00	0.12
188	000078	海王生物	107,500	517,075.00	0.12

189	300190	维尔利	94,120	512,954.00	0.12
190	600352	浙江龙盛	42,900	512,655.00	0.12
191	002024	苏宁易购	36,200	509,696.00	0.12
192	002335	科华恒盛	28,200	509,010.00	0.12
193	002156	通富微电	47,000	509,010.00	0.12
194	300395	菲利华	37,400	508,640.00	0.12
195	300463	迈克生物	20,400	508,572.00	0.12
196	600690	青岛海尔	26,400	508,464.00	0.12
197	000961	中南建设	80,300	506,693.00	0.12
198	002736	国信证券	55,500	505,050.00	0.12
199	300305	裕兴股份	83,300	503,965.00	0.12
200	002095	生意宝	14,000	502,460.00	0.12
201	002004	华邦健康	98,600	500,888.00	0.12
202	601000	唐山港	212,900	500,315.00	0.12
203	000551	创元科技	86,400	500,256.00	0.12
204	002682	龙洲股份	60,700	499,561.00	0.12
205	300187	永清环保	53,600	499,552.00	0.12
206	002152	广电运通	84,900	499,212.00	0.12
207	300285	国瓷材料	25,000	498,500.00	0.12
208	002487	大金重工	136,200	498,492.00	0.12
209	300432	富临精工	56,900	498,444.00	0.12
210	002294	信立泰	13,400	498,078.00	0.12
211	600516	方大炭素	20,400	497,352.00	0.11
212	300422	博世科	34,900	497,325.00	0.11
213	600603	广汇物流	123,380	495,987.60	0.11
214	600888	新疆众和	88,000	495,440.00	0.11
215	002398	建研集团	98,103	495,420.15	0.11
216	600168	武汉控股	76,600	494,836.00	0.11
217	002653	海思科	41,200	494,400.00	0.11
218	002561	徐家汇	54,600	494,130.00	0.11
219	600325	华发股份	63,900	493,947.00	0.11

220	002243	通产丽星	87,400	493,810.00	0.11
221	000833	贵糖股份	94,401	493,717.23	0.11
222	601601	中国太保	15,500	493,675.00	0.11
223	603288	海天味业	6,700	493,388.00	0.11
224	600741	华域汽车	20,800	493,376.00	0.11
225	300473	德尔股份	13,000	493,350.00	0.11
226	000001	平安银行	54,200	492,678.00	0.11
227	600518	康美药业	21,500	491,920.00	0.11
228	601566	九牧王	33,350	491,912.50	0.11
229	002493	荣盛石化	47,600	491,232.00	0.11
230	600658	电子城	93,560	489,318.80	0.11
231	600170	上海建工	160,700	488,528.00	0.11
232	601965	中国汽研	58,050	486,459.00	0.11
233	600859	王府井	22,600	480,702.00	0.11
234	601880	大连港	228,200	442,708.00	0.10
235	000156	华数传媒	45,300	436,692.00	0.10
236	600750	江中药业	24,468	434,307.00	0.10
237	000012	南玻A	83,897	415,290.15	0.10
238	002662	京威股份	93,000	390,600.00	0.09
239	002374	丽鹏股份	80,100	390,087.00	0.09
240	600141	兴发集团	33,000	384,450.00	0.09
241	300122	智飞生物	8,400	384,216.00	0.09
242	002236	大华股份	17,000	383,350.00	0.09
243	600580	卧龙电气	50,100	381,762.00	0.09
244	002557	洽洽食品	25,000	381,250.00	0.09
245	300295	三六五网	28,560	380,419.20	0.09
246	002258	利尔化学	19,600	379,456.00	0.09
247	002559	亚威股份	53,500	379,315.00	0.09
248	300460	惠伦晶体	36,645	379,275.75	0.09
249	000021	深科技	55,500	378,510.00	0.09
250	002424	贵州百灵	33,300	378,288.00	0.09

251	002331	皖通科技	51,100	378,140.00	0.09
252	002028	思源电气	22,500	377,775.00	0.09
253	000895	双汇发展	14,300	377,663.00	0.09
254	300098	高新兴	47,300	377,454.00	0.09
255	002449	国星光电	35,380	376,443.20	0.09
256	600662	强生控股	94,301	376,260.99	0.09
257	002315	焦点科技	26,000	375,960.00	0.09
258	600973	宝胜股份	103,000	375,950.00	0.09
259	002349	精华制药	64,300	375,512.00	0.09
260	300144	宋城演艺	15,900	373,650.00	0.09
261	300119	瑞普生物	43,700	373,635.00	0.09
262	300011	鼎汉技术	58,549	373,542.62	0.09
263	300405	科隆股份	41,870	373,480.40	0.09
264	300430	诚益通	37,670	373,309.70	0.09
265	002429	兆驰股份	150,500	373,240.00	0.09
266	002546	新联电子	100,000	373,000.00	0.09
267	601607	上海医药	15,600	372,840.00	0.09
268	600893	航发动力	16,700	372,744.00	0.09
269	600420	现代制药	35,800	372,320.00	0.09
270	600708	光明地产	86,500	371,950.00	0.09
271	601369	陕鼓动力	58,100	371,840.00	0.09
272	300408	三环集团	15,800	371,300.00	0.09
273	000563	陕国投 A	109,200	371,280.00	0.09
274	002107	沃华医药	40,300	371,163.00	0.09
275	000828	东莞控股	46,500	371,070.00	0.09
276	600809	山西汾酒	5,900	371,051.00	0.09
277	002187	广百股份	45,000	370,800.00	0.09
278	600894	广日股份	62,500	370,625.00	0.09
279	002060	粤水电	126,400	370,352.00	0.09
280	000404	华意压缩	85,500	370,215.00	0.09
281	002470	金正大	53,800	370,144.00	0.09

282	600369	西南证券	96,000	369,600.00	0.09
283	002550	千红制药	66,100	369,499.00	0.09
284	000026	飞亚达 A	41,880	369,381.60	0.09
285	600461	洪城水业	58,800	369,264.00	0.09
286	600027	华电国际	94,200	369,264.00	0.09
287	600081	东风科技	36,500	368,650.00	0.09
288	002287	奇正藏药	12,800	368,512.00	0.09
289	601107	四川成渝	107,400	368,382.00	0.09
290	002314	南山控股	91,300	367,939.00	0.09
291	601006	大秦铁路	44,800	367,808.00	0.08
292	002495	佳隆股份	125,020	367,558.80	0.08
293	601888	中国国旅	5,700	367,137.00	0.08
294	601988	中国银行	100,100	361,361.00	0.08
295	600015	华夏银行	48,400	360,580.00	0.08
296	002544	杰赛科技	26,300	360,047.00	0.08
297	000898	鞍钢股份	63,800	355,366.00	0.08
298	002073	软控股份	61,500	353,625.00	0.08
299	002224	三力士	58,400	348,064.00	0.08
300	600052	浙江广厦	90,700	338,311.00	0.08
301	603939	益丰药房	5,500	328,460.00	0.08
302	000536	华映科技	116,400	320,100.00	0.07
303	000552	靖远煤电	97,800	319,806.00	0.07
304	603636	南威软件	30,900	309,000.00	0.07
305	000049	德赛电池	10,800	304,776.00	0.07
306	002171	楚江新材	44,100	298,998.00	0.07
307	002602	世纪华通	8,900	289,250.00	0.07
308	601211	国泰君安	18,900	278,586.00	0.06
309	600748	上实发展	53,600	270,144.00	0.06
310	002279	久其软件	26,900	266,579.00	0.06
311	600845	宝信软件	10,000	263,500.00	0.06
312	300303	聚飞光电	94,200	258,108.00	0.06

313	002475	立讯精密	11,400	256,956.00	0.06
314	002626	金达威	14,800	256,780.00	0.06
315	300020	银江股份	26,900	255,819.00	0.06
316	002649	博彦科技	27,900	254,448.00	0.06
317	002775	文科园林	19,300	254,374.00	0.06
318	603808	歌力思	11,300	254,363.00	0.06
319	600309	万华化学	5,600	254,352.00	0.06
320	002380	科远股份	19,500	253,500.00	0.06
321	300488	恒锋工具	8,533	253,259.44	0.06
322	002631	德尔未来	34,200	253,080.00	0.06
323	002097	山河智能	38,600	252,444.00	0.06
324	000818	航锦科技	21,700	252,371.00	0.06
325	300231	银信科技	33,200	252,320.00	0.06
326	300298	三诺生物	12,200	252,296.00	0.06
327	002232	启明信息	32,300	252,263.00	0.06
328	002334	英威腾	43,100	252,135.00	0.06
329	300482	万孚生物	3,600	252,000.00	0.06
330	002206	海利得	50,500	251,995.00	0.06
331	300040	九洲电气	42,900	251,823.00	0.06
332	000826	启迪桑德	14,400	251,712.00	0.06
333	600048	保利地产	20,600	251,320.00	0.06
334	600386	北巴传媒	64,600	251,294.00	0.06
335	300316	晶盛机电	18,900	251,181.00	0.06
336	002245	澳洋顺昌	38,800	251,036.00	0.06
337	300050	世纪鼎利	41,800	250,800.00	0.06
338	002126	银轮股份	27,800	250,756.00	0.06
339	600288	大恒科技	32,300	250,648.00	0.06
340	000524	岭南控股	27,400	250,436.00	0.06
341	600775	南京熊猫	44,200	250,172.00	0.06
342	300006	莱美药业	60,100	250,016.00	0.06
343	603993	洛阳钼业	39,700	249,713.00	0.06



344	600176	中国巨石	24,400	249,612.00	0.06
345	002327	富安娜	23,000	249,320.00	0.06
346	600710	苏美达	57,700	249,264.00	0.06
347	600114	东睦股份	25,500	249,135.00	0.06
348	600837	海通证券	26,300	249,061.00	0.06
349	002238	天威视讯	37,000	249,010.00	0.06
350	300041	回天新材	27,200	248,880.00	0.06
351	300033	同花顺	6,400	248,768.00	0.06
352	300446	乐凯新材	13,500	248,535.00	0.06
353	000002	万科A	10,100	248,460.00	0.06
354	000777	中核科技	26,600	248,444.00	0.06
355	000419	通程控股	51,200	248,320.00	0.06
356	300239	东宝生物	58,700	248,301.00	0.06
357	002614	奥佳华	12,000	248,280.00	0.06
358	600624	复旦复华	48,200	248,230.00	0.06
359	000559	万向钱潮	36,500	248,200.00	0.06
360	002403	爱仕达	27,500	247,775.00	0.06
361	000880	潍柴重机	32,200	247,618.00	0.06
362	600551	时代出版	28,000	247,520.00	0.06
363	600706	曲江文旅	21,900	247,470.00	0.06
364	002043	兔宝宝	32,300	247,418.00	0.06
365	000682	东方电子	64,400	247,296.00	0.06
366	600085	同仁堂	7,000	246,960.00	0.06
367	603023	威帝股份	42,800	246,956.00	0.06
368	600567	山鹰纸业	63,900	246,654.00	0.06
369	000413	东旭光电	40,700	246,642.00	0.06
370	000966	长源电力	89,000	246,530.00	0.06
371	000783	长江证券	45,400	246,522.00	0.06
372	600248	延长化建	54,900	246,501.00	0.06
373	600050	中国联通	50,100	246,492.00	0.06
374	000589	黔轮胎A	74,900	246,421.00	0.06

375	600436	片仔癀	2,200	246,246.00	0.06
376	600736	苏州高新	40,700	246,235.00	0.06
377	600308	华泰股份	49,400	246,012.00	0.06
378	600299	安迪苏	21,100	245,604.00	0.06
379	601005	重庆钢铁	120,900	245,427.00	0.06
380	601009	南京银行	31,700	245,041.00	0.06
381	601618	中国中冶	73,500	244,755.00	0.06
382	600331	宏达股份	94,400	244,496.00	0.06
383	600886	国投电力	33,600	244,272.00	0.06
384	600377	宁沪高速	26,900	244,252.00	0.06
385	600816	安信信托	33,600	243,264.00	0.06
386	600028	中国石化	37,400	242,726.00	0.06
387	000529	广弘控股	42,900	241,098.00	0.06
388	601020	华钰矿业	17,200	237,188.00	0.05
389	002105	信隆健康	49,500	223,740.00	0.05
390	600618	氯碱化工	25,500	217,005.00	0.05
391	300240	飞力达	31,300	189,678.00	0.04
392	300485	赛升药业	12,800	184,192.00	0.04
393	002032	苏泊尔	3,200	164,800.00	0.04
394	600490	鹏欣资源	19,000	164,730.00	0.04
395	600678	四川金顶	15,900	162,816.00	0.04
396	300111	向日葵	53,800	147,412.00	0.03
397	000555	神州信息	10,100	134,128.00	0.03
398	002746	仙坛股份	11,700	132,678.00	0.03
399	002510	天汽模	27,900	131,967.00	0.03
400	002148	北纬科技	22,700	131,660.00	0.03
401	002050	三花智控	6,900	130,065.00	0.03
402	300251	光线传媒	12,700	129,286.00	0.03
403	300059	东方财富	9,800	129,164.00	0.03
404	002007	华兰生物	4,000	128,640.00	0.03
405	600486	扬农化工	2,300	128,639.00	0.03

406	002474	榕基软件	16,200	128,466.00	0.03
407	300232	洲明科技	13,000	128,440.00	0.03
408	300003	乐普医疗	3,500	128,380.00	0.03
409	300178	腾邦国际	9,100	127,946.00	0.03
410	300476	胜宏科技	8,300	127,820.00	0.03
411	600009	上海机场	2,300	127,604.00	0.03
412	002575	群兴玩具	32,100	127,437.00	0.03
413	000981	银亿股份	17,100	127,395.00	0.03
414	002401	中远海科	12,700	127,381.00	0.03
415	601688	华泰证券	8,500	127,245.00	0.03
416	300386	飞天诚信	10,800	127,116.00	0.03
417	000687	华讯方舟	13,800	127,098.00	0.03
418	000617	中油资本	11,300	127,012.00	0.03
419	300154	瑞凌股份	24,900	126,990.00	0.03
420	300511	雪榕生物	14,300	126,984.00	0.03
421	002027	分众传媒	13,260	126,898.20	0.03
422	300470	日机密封	2,700	126,819.00	0.03
423	603799	华友钴业	1,300	126,711.00	0.03
424	000733	振华科技	9,500	126,445.00	0.03
425	002203	海亮股份	15,600	126,360.00	0.03
426	002214	大立科技	23,100	126,357.00	0.03
427	600448	华纺股份	25,700	126,187.00	0.03
428	601231	环旭电子	13,900	126,073.00	0.03
429	000786	北新建材	6,800	126,004.00	0.03
430	603558	健盛集团	14,300	125,983.00	0.03
431	600803	新奥股份	10,900	125,786.00	0.03
432	002597	金禾实业	6,200	125,736.00	0.03
433	001979	招商蛇口	6,600	125,730.00	0.03
434	600330	天通股份	18,340	125,629.00	0.03
435	002717	岭南股份	12,800	125,568.00	0.03
436	300498	温氏股份	5,700	125,514.00	0.03

437	600592	龙溪股份	20,400	125,460.00	0.03
438	000963	华东医药	2,600	125,450.00	0.03
439	603309	维力医疗	10,400	125,424.00	0.03
440	600566	济川药业	2,600	125,294.00	0.03
441	300388	国祯环保	6,500	125,255.00	0.03
442	600078	澄星股份	36,200	125,252.00	0.03
443	002519	银河电子	28,200	125,208.00	0.03
444	002139	拓邦股份	22,000	125,180.00	0.03
445	002555	三七互娱	10,300	125,145.00	0.03
446	300174	元力股份	5,900	124,962.00	0.03
447	002750	龙津药业	17,400	124,932.00	0.03
448	600185	格力地产	23,000	124,890.00	0.03
449	002026	山东威达	20,400	124,848.00	0.03
450	002146	荣盛发展	14,300	124,839.00	0.03
451	002017	东信和平	20,100	124,821.00	0.03
452	002360	同德化工	22,900	124,805.00	0.03
453	000652	泰达股份	40,000	124,800.00	0.03
454	300371	汇中股份	8,200	124,722.00	0.03
455	300035	中科电气	23,000	124,660.00	0.03
456	600867	通化东宝	5,200	124,644.00	0.03
457	002667	鞍重股份	20,300	124,642.00	0.03
458	600346	恒力股份	8,500	124,610.00	0.03
459	002035	华帝股份	5,100	124,593.00	0.03
460	002009	天奇股份	10,400	124,488.00	0.03
461	300172	中电环保	22,100	124,423.00	0.03
462	600761	安徽合力	13,700	124,396.00	0.03
463	000635	英力特	13,400	124,218.00	0.03
464	000153	丰原药业	19,500	124,215.00	0.03
465	600459	贵研铂业	11,500	124,200.00	0.03
466	002205	国统股份	10,400	124,176.00	0.03
467	002363	隆基机械	21,900	124,173.00	0.03

468	002337	赛象科技	36,400	124,124.00	0.03
469	000623	吉林敖东	6,900	124,062.00	0.03
470	300193	佳士科技	21,500	124,055.00	0.03
471	601216	君正集团	36,800	124,016.00	0.03
472	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.03
473	000785	武汉中商	16,100	123,970.00	0.03
474	600088	中视传媒	13,100	123,926.00	0.03
475	002158	汉钟精机	13,800	123,924.00	0.03
476	000906	浙商中拓	24,100	123,874.00	0.03
477	600278	东方创业	15,700	123,873.00	0.03
478	600368	五洲交通	38,700	123,840.00	0.03
479	600613	神奇制药	20,200	123,826.00	0.03
480	002347	泰尔股份	31,500	123,795.00	0.03
481	600063	皖维高新	46,000	123,740.00	0.03
482	002566	益盛药业	17,600	123,728.00	0.03
483	300309	吉艾科技	6,100	123,708.00	0.03
484	603601	再升科技	14,120	123,691.20	0.03
485	600997	开滦股份	23,600	123,664.00	0.03
486	603688	石英股份	9,200	123,648.00	0.03
487	000919	金陵药业	16,500	123,585.00	0.03
488	300452	山河药辅	8,600	123,582.00	0.03
489	600398	海澜之家	9,700	123,578.00	0.03
490	000869	张裕A	3,100	123,566.00	0.03
491	000900	现代投资	29,700	123,552.00	0.03
492	601368	绿城水务	18,300	123,525.00	0.03
493	600637	东方明珠	8,200	123,492.00	0.03
494	600284	浦东建设	25,300	123,464.00	0.03
495	300477	合纵科技	6,400	123,392.00	0.03
496	603898	好莱客	4,700	123,328.00	0.03
497	000157	中联重科	30,000	123,300.00	0.03
498	002507	涪陵榨菜	4,800	123,264.00	0.03

499	000166	申万宏源	28,200	123,234.00	0.03
500	300398	飞凯材料	6,300	123,228.00	0.03
501	002081	金螳螂	12,200	123,220.00	0.03
502	603788	宁波高发	5,000	123,200.00	0.03
503	601100	恒立液压	5,900	123,192.00	0.03
504	000903	云内动力	48,100	123,136.00	0.03
505	000417	合肥百货	21,400	123,050.00	0.03
506	002303	美盈森	23,300	123,024.00	0.03
507	603100	川仪股份	14,548	122,930.60	0.03
508	002090	金智科技	8,500	122,910.00	0.03
509	600873	梅花生物	29,400	122,892.00	0.03
510	600057	厦门象屿	24,624	122,873.76	0.03
511	002536	西泵股份	11,200	122,864.00	0.03
512	002379	宏创控股	37,000	122,840.00	0.03
513	002084	海鸥住工	25,800	122,808.00	0.03
514	601021	春秋航空	3,500	122,605.00	0.03
515	600023	浙能电力	26,300	122,558.00	0.03
516	601158	重庆水务	22,600	122,492.00	0.03
517	600548	深高速	15,600	122,460.00	0.03
518	600177	雅戈尔	15,900	122,430.00	0.03
519	601166	兴业银行	8,500	122,400.00	0.03
520	000767	漳泽电力	48,000	122,400.00	0.03
521	601998	中信银行	19,700	122,337.00	0.03
522	601567	三星医疗	16,800	122,304.00	0.03
523	000040	东旭蓝天	12,100	122,210.00	0.03
524	603989	艾华集团	5,430	122,012.10	0.03
525	000531	穗恒运 A	24,300	121,986.00	0.03
526	000059	华锦股份	17,700	121,953.00	0.03
527	601088	中国神华	6,100	121,634.00	0.03
528	600007	中国国贸	8,400	121,548.00	0.03
529	002352	顺丰控股	2,700	121,500.00	0.03

530	600739	辽宁成大	8,000	121,440.00	0.03
531	603123	翠微股份	19,900	121,390.00	0.03
532	002202	金风科技	9,600	121,344.00	0.03
533	600276	恒瑞医药	1,600	121,216.00	0.03
534	600966	博汇纸业	28,100	121,111.00	0.03
535	002112	三变科技	18,200	121,030.00	0.03
536	300284	苏交科	15,200	120,536.00	0.03
537	002488	金固股份	11,100	119,769.00	0.03
538	002572	索菲亚	3,700	119,066.00	0.03
539	002330	得利斯	22,300	118,413.00	0.03
540	000538	云南白药	1,100	117,656.00	0.03
541	000036	华联控股	18,500	109,890.00	0.03
542	600227	圣济堂	28,100	105,656.00	0.02
543	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.02
544	300069	金利华电	6,600	78,804.00	0.02
545	002467	二六三	14,200	76,964.00	0.02
546	002420	毅昌股份	12,900	53,019.00	0.01
547	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
548	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.01
549	601788	光大证券	3,900	42,822.00	0.01
550	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
551	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00
552	002133	广宇集团	2,300	9,959.00	0.00

## 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	002422	科伦药业	33,513,465.00	5.19
2	002195	三四五	33,259,148.70	5.15

3	600426	华鲁恒升	32,081,013.06	4.97
4	000786	北新建材	29,951,990.50	4.64
5	600585	海螺水泥	29,946,987.66	4.64
6	300182	捷成股份	29,207,575.25	4.52
7	000418	小天鹅 A	28,647,629.28	4.44
8	300274	阳光电源	28,001,521.52	4.34
9	002311	海大集团	26,706,026.43	4.14
10	600056	中国医药	26,662,610.57	4.13
11	600201	生物股份	26,454,529.10	4.10
12	000027	深圳能源	26,428,665.54	4.09
13	600208	新湖中宝	25,851,866.56	4.00
14	002078	太阳纸业	25,294,781.72	3.92
15	601006	大秦铁路	24,872,157.10	3.85
16	600176	中国巨石	24,705,604.60	3.83
17	600572	康恩贝	24,422,134.46	3.78
18	600525	长园集团	23,912,201.51	3.70
19	000078	海王生物	23,869,915.44	3.70
20	601233	桐昆股份	23,843,523.35	3.69
21	002440	闰土股份	23,357,829.61	3.62
22	002589	瑞康医药	22,039,855.87	3.41
23	600094	大名城	21,715,281.09	3.36
24	000039	中集集团	21,313,933.00	3.30
25	000690	宝新能源	20,916,797.69	3.24
26	600170	上海建工	20,146,106.47	3.12
27	600143	金发科技	20,008,204.50	3.10
28	600582	天地科技	19,595,536.00	3.04
29	000400	许继电气	19,395,482.54	3.00
30	002013	中航机电	19,324,673.43	2.99
31	000050	深天马 A	19,086,748.13	2.96
32	000568	泸州老窖	19,026,503.05	2.95
33	000581	威孚高科	18,981,502.90	2.94



34	000860	顺鑫农业	18,972,177.09	2.94
35	000778	新兴铸管	18,772,388.00	2.91
36	002050	三花智控	18,573,193.92	2.88
37	600755	厦门国贸	18,395,253.12	2.85
38	600332	白云山	18,356,796.60	2.84
39	002463	沪电股份	17,590,385.96	2.73
40	600062	华润双鹤	17,558,407.18	2.72
41	600028	中国石化	17,355,004.00	2.69
42	600674	川投能源	17,249,082.00	2.67
43	600900	长江电力	17,246,056.34	2.67
44	600266	北京城建	16,932,183.00	2.62
45	002304	洋河股份	16,912,142.90	2.62
46	600884	杉杉股份	16,891,458.61	2.62
47	600688	上海石化	16,856,258.00	2.61
48	600859	王府井	16,836,941.01	2.61
49	600511	国药股份	16,822,613.44	2.61
50	600038	中直股份	16,714,595.05	2.59
51	600256	广汇能源	16,658,409.67	2.58
52	000685	中山公用	16,583,908.60	2.57
53	600739	辽宁成大	16,424,264.40	2.54
54	600522	中天科技	16,220,919.00	2.51
55	002152	广电运通	15,665,551.75	2.43
56	000541	佛山照明	15,342,041.99	2.38
57	600881	亚泰集团	15,243,434.28	2.36
58	603589	口子窖	15,225,709.85	2.36
59	600600	青岛啤酒	15,220,337.12	2.36
60	000012	南玻A	14,987,274.93	2.32
61	600521	华海药业	14,868,047.22	2.30
62	300287	飞利信	14,780,822.20	2.29
63	600335	国机汽车	14,704,571.41	2.28
64	601717	郑煤机	14,545,473.12	2.25

65	600565	迪马股份	14,338,035.75	2.22
66	600729	重庆百货	14,337,786.37	2.22
67	600195	中牧股份	14,224,896.17	2.20
68	000703	恒逸石化	13,954,386.67	2.16
69	600704	物产中大	13,936,974.35	2.16
70	002191	劲嘉股份	13,923,029.08	2.16
71	603328	依顿电子	13,879,188.89	2.15
72	600611	大众交通	13,870,028.50	2.15
73	000536	华映科技	13,818,015.61	2.14
74	000998	隆平高科	13,762,919.30	2.13
75	600894	广日股份	13,740,127.00	2.13
76	600750	江中药业	13,550,430.45	2.10
77	600655	豫园股份	13,492,045.78	2.09
78	600037	歌华有线	13,368,129.19	2.07
79	002439	启明星辰	13,300,006.67	2.06
80	000937	冀中能源	13,261,554.00	2.05
81	000990	诚志股份	13,183,112.60	2.04
82	601225	陕西煤业	13,166,337.89	2.04
83	000895	双汇发展	13,061,006.89	2.02
84	002244	滨江集团	12,974,776.00	2.01
85	002001	新和成	12,974,244.93	2.01

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600585	海螺水泥	38,646,737.68	5.99
2	002195	二三四五	34,170,752.36	5.29
3	002422	科伦药业	32,590,091.22	5.05
4	300182	捷成股份	32,554,053.31	5.04

5	600426	华鲁恒升	30,191,631.72	4.68
6	600056	中国医药	29,442,470.96	4.56
7	600525	长园集团	29,335,297.31	4.54
8	000786	北新建材	29,054,541.73	4.50
9	300274	阳光电源	28,381,253.31	4.40
10	600572	康恩贝	28,164,561.50	4.36
11	601006	大秦铁路	27,923,049.69	4.33
12	000078	海王生物	27,491,492.30	4.26
13	600208	新湖中宝	27,157,424.89	4.21
14	600582	天地科技	26,141,107.14	4.05
15	002311	海大集团	26,064,435.66	4.04
16	000418	小天鹅A	25,032,605.07	3.88
17	601233	桐昆股份	24,746,687.01	3.83
18	600900	长江电力	24,685,935.86	3.82
19	000027	深圳能源	24,290,549.40	3.76
20	600176	中国巨石	24,152,884.81	3.74
21	600688	上海石化	23,517,350.61	3.64
22	000860	顺鑫农业	23,167,224.03	3.59
23	000685	中山公用	22,914,939.62	3.55
24	002013	中航机电	22,528,124.53	3.49
25	000400	许继电气	22,477,860.10	3.48
26	002440	闰土股份	22,314,121.45	3.46
27	600201	生物股份	21,948,680.29	3.40
28	002589	瑞康医药	21,762,307.70	3.37
29	600755	厦门国贸	21,521,947.24	3.33
30	600739	辽宁成大	21,373,029.82	3.31
31	600674	川投能源	21,037,037.99	3.26
32	600094	大名城	21,003,781.64	3.25
33	000690	宝新能源	20,815,055.78	3.22
34	000039	中集集团	20,695,898.68	3.21
35	002078	太阳纸业	20,637,732.32	3.20

36	000612	焦作万方	20,421,397.00	3.16
37	600729	重庆百货	20,106,045.05	3.11
38	600170	上海建工	19,431,485.70	3.01
39	000012	南玻A	19,412,982.00	3.01
40	000030	富奥股份	19,399,503.40	3.01
41	000568	泸州老窖	19,315,183.32	2.99
42	000050	深天马A	19,193,470.00	2.97
43	603328	依顿电子	19,043,170.56	2.95
44	000581	威孚高科	18,880,826.03	2.93
45	601678	滨化股份	18,775,884.08	2.91
46	000069	华侨城A	18,693,468.60	2.90
47	002304	洋河股份	18,402,592.77	2.85
48	002050	三花智控	18,309,341.79	2.84
49	600028	中国石化	18,292,878.81	2.83
50	600332	白云山	18,250,587.80	2.83
51	600195	中牧股份	18,243,393.67	2.83
52	000778	新兴铸管	17,905,598.00	2.77
53	600884	杉杉股份	17,586,661.27	2.72
54	600062	华润双鹤	17,375,717.30	2.69
55	600750	江中药业	17,333,187.52	2.69
56	600219	南山铝业	17,062,174.93	2.64
57	600038	中直股份	17,032,378.15	2.64
58	000895	双汇发展	16,567,146.21	2.57
59	002491	通鼎互联	16,342,841.46	2.53
60	600019	宝钢股份	16,287,863.53	2.52
61	000513	丽珠集团	16,267,029.30	2.52
62	600859	王府井	16,099,101.33	2.49
63	600143	金发科技	16,057,710.34	2.49
64	600565	迪马股份	15,977,645.07	2.48
65	601225	陕西煤业	15,824,828.59	2.45
66	002152	广电运通	15,773,084.60	2.44

67	002608	江苏国信	15,610,141.90	2.42
68	600511	国药股份	15,590,238.39	2.42
69	601717	郑煤机	15,519,110.86	2.40
70	600521	华海药业	15,513,090.44	2.40
71	600236	桂冠电力	15,376,628.54	2.38
72	600366	宁波韵升	15,282,332.42	2.37
73	002463	沪电股份	15,182,303.48	2.35
74	002416	爱施德	15,153,585.78	2.35
75	600522	中天科技	15,152,730.59	2.35
76	600256	广汇能源	15,134,615.01	2.34
77	000902	新洋丰	15,095,812.59	2.34
78	300287	飞利信	15,004,135.59	2.32
79	002385	大北农	14,973,072.49	2.32
80	600486	扬农化工	14,621,298.59	2.27
81	600757	长江传媒	14,533,733.56	2.25
82	300297	蓝盾股份	14,327,504.92	2.22
83	600266	北京城建	14,313,318.69	2.22
84	600881	亚泰集团	14,196,924.45	2.20
85	600557	康缘药业	14,171,226.12	2.20
86	600335	国机汽车	14,155,281.43	2.19
87	000100	TCL 集团	13,849,648.00	2.15
88	600153	建发股份	13,793,098.92	2.14
89	000998	隆平高科	13,689,511.00	2.12
90	002439	启明星辰	13,650,072.68	2.11
91	600551	时代出版	13,632,144.11	2.11
92	000876	新希望	13,598,295.13	2.11
93	600651	飞乐音响	13,579,439.56	2.10
94	600704	物产中大	13,567,090.99	2.10
95	603589	口子窖	13,465,455.38	2.09
96	002191	劲嘉股份	13,343,815.08	2.07
97	000541	佛山照明	13,338,795.12	2.07

98	002001	新和成	13,333,234.82	2.07
99	600655	豫园股份	13,244,847.67	2.05
100	000990	诚志股份	12,936,850.10	2.00
101	300303	聚飞光电	12,934,724.98	2.00

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

买入股票成本（成交）总额	5,369,416,786.27
卖出股票收入（成交）总额	5,532,934,849.57

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	10,001,000.00	2.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	963,648.00	0.22
	其中：政策性金融债	963,648.00	0.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,964,648.00	2.53

#### 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	019571	17国债17	100,000	10,001,000.	2.31

				00	
2	018005	国开1701	9,600	963,648.00	0.22

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1812	IC1812	38	38,063,840.00	745,920.00	符合本基金的收益风险特征
公允价值变动总额合计(元)					745,920.00
股指期货投资本期收益(元)					-1,064,976.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-49,320.00

#### 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 2017年12月18日，金科地产集团股份有限公司（下称“金科股份”，股票代码：000656）收到中国银行间市场交易商协会（以下简称“交易商协会”）发布的通报批评处分公告，认定金科股份作为债务融资工具发行人，在债务融资工具发行存续期间存在未及时披露首先资产情况等违反银行间市场相关自律规则指引的行为。

本基金投研人员分析认为，在收到交易商协会的通报批评后，金科股份改正态度积极，并迅速做出反应，积极整改，该事件发生后该公司经营状况正常。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金科股份进行了投资。

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	8,068,801.91
2	应收证券清算款	2,681,708.61
3	应收股利	-
4	应收利息	343,891.55
5	应收申购款	7,069.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,101,471.26

### 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 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000415	渤海金控	3,577,584.00	0.83	重大事项停牌

## § 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
创金合信量化发现混合A	2,360	151,300.12	50,008,000.00	14.01%	307,060,285.15	85.99%
创金合信量化发现混合C	1,902	87,604.92	10,009.90	0.01%	166,614,550.59	99.99%
合计	4,221	124,068.43	50,018,009.90	9.55%	473,674,835.74	90.45%

## 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	创金合信量化发现混合A	2,993,464.36	0.84%
	创金合信量化发现混合C	70,258.65	0.04%
	合计	3,063,723.01	0.59%

## 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	创金合信量化发现	10~50

和研究部门负责人持有本开放式基金	混合A	
	创金合信量化发现混合C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信量化发现混合A	0
	创金合信量化发现混合C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信量化发现混合A	创金合信量化发现混合C
基金合同生效日(2016年09月27日)基金份额总额	848,356,409.28	664,443,676.93
本报告期期初基金份额总额	481,598,548.49	207,547,528.35
本报告期基金总申购份额	13,587,502.99	3,754,665.52
减：本报告期基金总赎回份额	138,117,766.33	44,677,633.38
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	357,068,285.15	166,624,560.49

## § 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、基金托管人的专门基金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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	304,537,190.21	2.79%	131,354.18	3.41%	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证	2	-	-	-	-	-

券						
第一创业证券	2	399,233,599.26	3.66%	128,240.35	3.32%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	146,318,446.11	1.34%	104,077.60	2.70%	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	2,408,881,697.00	22.10%	767,806.00	19.91%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	258,999,245.23	2.38%	108,761.59	2.82%	-
光大证券	2	398,732,903.38	3.66%	167,433.43	4.34%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	95,285,775.40	0.87%	31,570.09	0.82%	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	1,015,996,912.81	9.32%	327,060.48	8.48%	-

招商 证券	2	-	-	-	-	-
长江 证券	2	1,879,047,694.82	17.24%	412,016.60	10.68%	-
中投 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	662,909,703.46	6.08%	277,725.93	7.20%	-
恒泰 证券	2	-	-	-	-	-
中信 证券	4	-	-	-	-	-
安信 证券	4	3,329,147,244.97	30.55%	1,401,085.53	36.32%	-
银河 证券	4	-	-	-	-	-

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要，并能为基金提供全面的信息服务。

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。

本基金报告期内新增方正证券、中金公司、江海证券、恒泰证券4家券商的8个交易单元，退租金元证券的2个交易单元。

## 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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	86,107.70	0.63%	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	1,701,225.11	12.54%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	10,667,441.75	78.63%	-	-	-	-	-	-
中投证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	1,112,566.03	8.20%	1,400,000.00	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	公司官网、中国证券报	2018-01-02
2	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金2017年第四季度报告	公司官网、中国证券报	2018-01-19
3	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加苏宁金融为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2018-01-29
4	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报	2018-02-10
5	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报	2018-02-22
6	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加平安银行为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2018-03-05
7	创金合信基金管理有限公司关于创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金修订基金合同、托管协议部分条款及调整赎回费相关规则	公司官网、中国证券报	2018-03-28

	的公告		
8	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金（2017年第2号）招募说明书（更新）（2018年3月修订）	公司官网、中国证券报	2018-03-28
9	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2018年3月修订）	公司官网、中国证券报	2018-03-28
10	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金托管协议（2018年3月修订）	公司官网、中国证券报	2018-03-28
11	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）（2018年3月修订）	公司官网、中国证券报	2018-03-28
12	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告	公司官网、中国证券报	2018-03-31
13	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2018-03-31
14	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金2018年第1季度报告	公司官网、中国证券报	2018-04-19
15	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金（2018年第1号）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报	2018-05-10
16	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018年第1号）	公司官网、中国证券报	2018-05-10
17	创金合信基金管理有限公司	公司官网、中国证券报	2018-05-17



	关于旗下部分开放式基金增加代销机构的公告		
18	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与银河证券费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2018-05-18
19	创金合信基金管理有限公司关于旗下开放式基金参与第一创业证券费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2018-05-24
20	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告	公司官网、中国证券报	2018-06-07
21	创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2018年6月修订）	公司官网、中国证券报	2018-06-07
22	创金合信基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报	2018-06-15
23	创金合信基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	公司官网、中国证券报	2018-06-21
24	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加济安财富为代销机构的公告	公司官网、中国证券报	2018-06-28

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金在报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金2018年半年度报告原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

### 12.3 查阅方式

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司  
二〇一八年八月二十九日