

创金合信量化多因子股票型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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:2020 年 08 月 31 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。本中期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2020年08月20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2020年01月01日起至2020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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	12
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	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(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	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	59
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	59
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	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61

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	62
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信量化多因子股票型证券投资基金	
基金简称	创金合信量化多因子股票	
基金主代码	002210	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年01月22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	243,319,372.08份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C
下属分级基金的交易代码	002210	003865
报告期末下属分级基金的份额总额	240,719,561.02份	2,599,811.06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	本基金为股票型基金，股票投资部分占基金资产的比例不低于80%。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	中证1000指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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×90%+2%”变更为“中证1000指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率（税后）×10%”。上述事项已于2018年6月7日在指定媒体上公告。

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
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋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	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金中期报告备置地点	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(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C
本期已实现收益	69,434,419.75	596,375.57
本期利润	76,209,450.30	632,018.16
加权平均基金份额本期利润	0.2194	0.1881
本期加权平均净值利润率	17.79%	15.61%
本期基金份额净值增长率	19.25%	18.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	80,023,838.68	782,077.38
期末可供分配基金份额利润	0.3324	0.3008
期末基金资产净值	333,041,780.29	3,511,109.06
期末基金份额净值	1.3835	1.3505
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	38.35%	7.10%

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

创金合信量化多因子股票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	10.27%	0.84%	7.77%	0.80%	2.50%	0.04%
过去三个月	19.79%	1.09%	14.74%	1.11%	5.05%	-0.02%
过去六个月	19.25%	1.72%	12.32%	1.69%	6.93%	0.03%
过去一年	28.02%	1.43%	17.09%	1.40%	10.93%	0.03%
过去三年	22.87%	1.36%	-2.74%	1.38%	25.61%	-0.02%
自基金合同生效起至今	38.35%	1.26%	4.28%	1.35%	34.07%	-0.09%

创金合信量化多因子股票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	10.20%	0.84%	7.77%	0.80%	2.43%	0.04%
过去三个月	19.57%	1.09%	14.74%	1.11%	4.83%	-0.02%
过去六个月	18.80%	1.72%	12.32%	1.69%	6.48%	0.03%
过去一年	27.13%	1.43%	17.09%	1.40%	10.04%	0.03%
过去三年	20.37%	1.36%	-2.74%	1.38%	23.11%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.10%	1.32%	-5.37%	1.32%	12.47%	0.00%

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



§ 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3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。公司注册资本2.33亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%。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8只公募基金。截至2020年6月30日，本公司共管理49只公募基金，其中混合型产品13只、指数型产品5只、债券型产品20只、股票型产品10只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约340.38亿元。

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		
董梁	本基金基金经理、首席量化官兼任量化指数与国际部总监	2019-07-05	-	16年	董梁先生，中国香港，美国密歇根大学材料科学博士，2005年3月加入美国巴克莱环球投资者(Barclays Global Investors)任高级研究员、基金经理，负责美股量化模型开发及投资工作。2009年8月加入瑞士信贷(Credit-Suisse)任自营交易员，负责港股量化模型开发和投资，以及环球股指期货期权的量化投资。2011年1月加入信达国际任执行董事

					、基金经理,进行港股投资。2012年8月加入华安基金管理有限公司,任系统化投资部量化投资总监、基金经理。2015年加入香港启智资产管理有限公司(Zentific Investment Management)任投资部基金经理。2017年9月加入创金合信基金管理有限公司,现任首席量化投资官,兼量化指数与国际部总监、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、证券从业年限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《公开募集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，本基金与管理人管理的其他投资组合构成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1次，本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

上半年市场板块间分化明显，小市值股票更受青睐。其中创业板指数上涨35.60%，代表蓝筹股票的上证50指数跌幅为-3.95%，沪深300指数涨幅1.64%，代表中小市值股票的中证500和中证1000指数涨幅分别为11.33%，13.52%。中证1000指数成分股中，按中信一级行业分类统计，30个行业仅4个行业下跌，医药涨幅62%位列第一，建材和食品医疗涨幅也超过了50%。银行和钢铁跌幅均超过10%。从风格来看，动量因子表现较佳，估值及流动性因子表现较差。

报告期内模型运行平稳，我们坚持以自下而上选股为主进行量化投资，严格控制各个维度上的风险暴露，在此基础上追求超额收益。

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多因子股票A基金份额净值为1.3835元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为19.25%，同期业绩比较基准收益率为12.32%；截至报告期末创金合信量化多因子股票C基金份额净值为1.3505元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为18.80%，同期业绩比较基准收益率为12.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场流动性充裕、利率水平维持低位，国内经济活动正在逐步复苏，中美贸易摩擦被市场消化，市场情绪回暖，我们对后市比较乐观。

上半年工业生产及消费均受到疫情较大程度的影响，尤其是严控人员流动给消费和服务业带来压力，但国内逆周期政策及时落地，保障了金融市场与实体经济流动性。由于海外疫情尚未达到拐点，全球产业链承压会给出出口相关产业带来压力，如制造业、外贸行业等等，全球联动性较高的行业受影响时长也会更久，例如传媒、休闲服务和航空等。融资环境改善偏慢，企业债务违约比例依然偏高，个股选择的风险在增加。

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

本基金本报告期内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多因子股票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,创金合信量化多因子股票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多因子股票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,创金合信量化多因子股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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多因子股票型证券投资基金2020年中期报告中财务指标、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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	6,864,950.23	7,435,117.54
结算备付金		3,302,521.98	5,924,536.13
存出保证金		98,235.65	992,720.06
交易性金融资产	6.4.7.2	322,691,883.50	547,796,192.74
其中：股票投资		304,702,940.50	523,616,192.74
基金投资		-	-
债券投资		17,988,943.00	24,180,000.00
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		9,821,995.76	7,070,134.58
应收利息	6.4.7.5	575,858.13	357,931.48
应收股利		-	-
应收申购款		314,490.50	50,277.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		343,669,935.75	569,626,910.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债：			
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		2,660,860.80	1,373,968.11
应付赎回款		3,378,004.33	1,807,094.16
应付管理人报酬		451,748.01	720,227.88
应付托管费		75,291.34	120,037.97
应付销售服务费		2,091.60	2,648.30
应付交易费用	6.4.7.7	330,398.41	601,185.67
应交税费		-	4,463.90
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	218,651.91	209,270.31
负债合计		7,117,046.40	4,838,896.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	243,319,372.08	486,867,481.29
未分配利润	6.4.7.10	93,233,517.27	77,920,532.43
所有者权益合计		336,552,889.35	564,788,013.72
负债和所有者权益总计		343,669,935.75	569,626,910.02

注：报告截止日2020年06月30日，基金份额总额243,319,372.08份，其中下属A类基金份额240,719,561.02份，C类基金份额2,599,811.06份。下属A类基金份额净值1.3835元，C类基金份额净值1.3505元。

6.2 利润表

会计主体：创金合信量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
一、收入		82,932,091.58	199,199,482.27
1. 利息收入		511,085.92	1,192,525.31

其中：存款利息收入	6.4.7.11	77,070.03	531,117.68
债券利息收入		434,015.89	661,407.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		75,555,650.19	177,328,628.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	72,869,952.44	157,796,580.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-34,875.70	32,957.17
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	633,902.91	12,432,268.24
股利收益	6.4.7.15	2,086,670.54	7,066,822.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	6,810,673.14	20,183,017.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	54,682.33	495,310.80
减：二、费用		6,090,623.12	19,433,596.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,243,691.90	5,892,491.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	540,615.28	982,081.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	15,141.51	351,272.79
4. 交易费用	6.4.7.18	2,180,497.33	12,032,889.64
5. 利息支出		52.47	13,552.46

其中：卖出回购金融资产支出		52.47	13,552.46
6. 税金及附加		2,282.05	44,780.86
7. 其他费用	6.4.7.19	108,342.58	116,528.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		76,841,468.46	179,765,885.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		76,841,468.46	179,765,885.48

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020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）	486,867,481.29	77,920,532.43	564,788,013.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	76,841,468.46	76,841,468.46
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）	-243,548,109.21	-61,528,483.62	-305,076,592.83
其中：1. 基金申购款	16,963,316.47	3,702,877.82	20,666,194.29
2. 基金赎回款	-260,511,425.68	-65,231,361.44	-325,742,787.12
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）	243,319,372.08	93,233,517.27	336,552,889.35
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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）	711,331,486.96	-86,304,840.70	625,026,646.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	179,765,885.48	179,765,885.48
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）	-122,905,321.73	-46,066,671.60	-168,971,993.33
其中：1. 基金申购款	505,730,767.35	-13,533,140.27	492,197,627.08
2. 基金赎回款	-628,636,089.08	-32,533,531.33	-661,169,620.41
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）	588,426,165.23	47,394,373.18	635,820,538.41

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

创金合信量化多因子股票型证券投资基金(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[2015]第2238号《关于准予创金合信量化多因子股票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《创金合信量化多因子股票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202,600,123.85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086号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同》于2016年1月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为202,639,215.47份基金份额,其中认购资金利息折合39,091.62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《创金合信量化多因子股票型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信量化多因子股票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。本基金的业绩比较基准为:中证1000指数收益率 \times 90%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 10%。

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<年度报告和中期报告>》、中国证券业协会(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》、《创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注

7.4.4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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际

买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2020年06月30日
活期存款	6,864,950.23
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	6,864,950.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		281,669,362.55	304,702,940.50	23,033,577.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	18,105,957.76	17,988,943.00	-117,014.76
	银行间市场	-	-	-
	合计	18,105,957.76	17,988,943.00	-117,014.76
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		299,775,320.31	322,691,883.50	22,916,563.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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 2020年06月30日
应收活期存款利息	645.81
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	1,535.66
应收债券利息	573,632.46
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	44.20
合计	575,858.13

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 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	330,398.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	330,398.41

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	171.33
预提费用	218,480.58
合计	218,651.91

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信量化多因子股票A

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	483,239,360.48	483,239,360.48

本期申购	14,193,534.06	14,193,534.06
本期赎回（以“-”号填列）	-256,713,333.52	-256,713,333.52
本期末	240,719,561.02	240,719,561.02

6.4.7.9.2 创金合信量化多因子股票C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信量化多因子股票C)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,628,120.81	3,628,120.81
本期申购	2,769,782.41	2,769,782.41
本期赎回（以“-”号填列）	-3,798,092.16	-3,798,092.16
本期末	2,599,811.06	2,599,811.06

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 创金合信量化多因子股票A

单位：人民币元

项目 (创金合信量化多因子股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	65,521,102.53	11,903,200.88	77,424,303.41
本期利润	69,434,419.75	6,775,030.55	76,209,450.30
本期基金份额交易产生的变动数	-54,931,683.60	-6,379,850.84	-61,311,534.44
其中：基金申购款	3,175,760.21	-340.31	3,175,419.90
基金赎回款	-58,107,443.81	-6,379,510.53	-64,486,954.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,023,838.68	12,298,380.59	92,322,219.27

6.4.7.10.2 创金合信量化多因子股票C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(创金合信量化多因子股票C)			
上年度末	409,312.03	86,916.99	496,229.02
本期利润	596,375.57	35,642.59	632,018.16
本期基金份额交易产生的变动数	-223,610.22	6,661.04	-216,949.18
其中：基金申购款	545,851.90	-18,393.98	527,457.92
基金赎回款	-769,462.12	25,055.02	-744,407.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	782,077.38	129,220.62	911,298.00

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	37,478.58
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	38,723.36
其他	868.09
合计	77,070.03

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	1,185,154,140.31
减：卖出股票成本总额	1,112,284,187.87
买卖股票差价收入	72,869,952.44

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
	2020年01月01日至2020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	-34,875.70
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	-34,875.70

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
	2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,332,942.88
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,110,435.70
减：应收利息总额	257,382.88
买卖债券差价收入	-34,875.70

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

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
	2020年01月01日至2020年06月30日
期货投资	633,902.91

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,086,670.54
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,086,670.54

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	6,978,073.14
——股票投资	7,081,494.44
——债券投资	-103,421.30
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-167,400.00
——权证投资	-
——期货投资	-167,400.00
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	6,810,673.14

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	54,276.24
转换费收入	406.09

合计	54,682.33
----	-----------

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	2,178,138.93
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	2,358.40
合计	2,180,497.33

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	29,808.24
信息披露费	59,672.34
汇划手续费	262.00
账户维护费	18,000.00
查询服务费	600.00
合计	108,342.58

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
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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**

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股票交易。

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

本基金于本报告期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

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 2020年01月01日至202	上年度可比期间 2019年01月01日至201

	0年06月30日	9年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,243,691.90	5,892,491.04
其中：支付销售机构的客户维护费	1,905,800.23	3,012,324.28

注：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 2020年01月01日至2020 年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	540,615.28	982,081.75

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，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付给基金托管人。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 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C	合计

中国工商银行	0.00	1,076.53	1,076.53
创金合信直销	0.00	195.63	195.63
合计	0.00	1,272.16	1,272.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C	合计
中国工商银行	0.00	1,770.57	1,770.57
创金合信直销	0.00	318,813.54	318,813.54
合计	0.00	320,584.11	320,584.11

本基金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0.75%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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5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。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 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	6,864,950.23	37,478.58	20,901,586.62	68,873.30

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——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020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
688505	复旦张江	2020-06-10	2020-12-21	新股锁定	8.95	24.78	20,896	187,019.20	517,802.88	-
688186	广大特材	2020-01-	2020-08-	新股锁定	17.16	34.15	8,033	137,846.	274,326.	-

		23	11					28	95	
688004	博汇科技	2020-06-05	2020-12-14	新股锁定	28.77	71.90	2,500	71,925.00	179,750.00	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新发流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新发流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新发流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688096	京源环保	2020-03-31	2020-10-09	新股锁定	14.34	21.42	4,485	64,314.90	96,068.70	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新发流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新发流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新发流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新发流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新发流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-	2020-07-	新发流通	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-

		30	08	受限						
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新发流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

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
002254	泰和新材	2020-06-29	重大事项停牌	13.60	2020-07-14	14.96	28,300	349,155.18	384,880.00	-
600090	*ST济堂	2020-06-30	重大事项停牌	2.90	2020-07-01	2.76	56,701	194,905.98	164,432.90	-

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2020年06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2020年06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金融工具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、合规与风险管理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和债券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（场内）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，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	17,988,943.00	24,180,000.00
合计	17,988,943.00	24,180,000.00

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。

于2020年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同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，因此账面余额约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期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证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式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%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合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30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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。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%。于2020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0.65%。

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2020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338,095,881.81元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。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。

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2020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	6,864,950.23	-	-	-	6,864,950.23
结算备付金	3,302,521.98	-	-	-	3,302,521.98
存出保证金	98,235.65	-	-	-	98,235.65
交易性金融资产	17,988,943.00	-	-	304,702,940.50	322,691,883.50
应收证券清算款	-	-	-	9,821,995.76	9,821,995.76
应收利息	-	-	-	575,858.13	575,858.13
应收申购款	-	-	-	314,490.50	314,490.50
资产总计	28,254,650.86	-	-	315,415,284.89	343,669,935.75

负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,660,860.80	2,660,860.80
应付赎回款	-	-	-	3,378,004.33	3,378,004.33
应付管理人报酬	-	-	-	451,748.01	451,748.01
应付托管费	-	-	-	75,291.34	75,291.34
应付销售服务费	-	-	-	2,091.60	2,091.60
应付交易费用	-	-	-	330,398.41	330,398.41
其他负债	-	-	-	218,651.91	218,651.91
负债总计	-	-	-	7,117,046.40	7,117,046.40
利率敏感度缺口	28,254,650.86	-	-	308,298,238.49	336,552,889.35
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,435,117.54	-	-	-	7,435,117.54
结算备付金	5,924,536.13	-	-	-	5,924,536.13
存出保证金	992,720.06	-	-	-	992,720.06
交易性金融资产	24,180,000.00	-	-	523,616,192.74	547,796,192.74
应收证券清算款	-	-	-	7,070,134.58	7,070,134.58
应收利息	-	-	-	357,931.48	357,931.48
应收申购款	-	-	-	50,277.49	50,277.49
资产总	38,532,373.73	-	-	531,094,536.29	569,626,910.02

计					
负债					
应付证 券清算 款	-	-	-	1,373,968.11	1,373,968.11
应付赎 回款	-	-	-	1,807,094.16	1,807,094.16
应付管 理人报 酬	-	-	-	720,227.88	720,227.88
应付托 管费	-	-	-	120,037.97	120,037.97
应付销 售服务 费	-	-	-	2,648.30	2,648.30
应付交 易费用	-	-	-	601,185.67	601,185.67
应交税 费	-	-	-	4,463.90	4,463.90
其他负 债	-	-	-	209,270.31	209,270.31
负债总 计	-	-	-	4,838,896.30	4,838,896.30
利率敏 感度缺 口	38,532,373.73	-	-	526,255,639.99	564,788,013.72

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2020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5.35%(2019年12月31日：4.28%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019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 2020年06月30日		上年度末 2019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	304,702,940.50	90.54	523,616,192.74	92.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	304,702,940.50	90.54	523,616,192.74	92.71

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他条件不变的情况下		
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	上年度末

		2020年06月30日	2019年12月31日
	比较基准上涨5%	16,135,786.20	29,696,988.97
	比较基准下降5%	-16,135,786.20	-29,696,988.97

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2020年06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302,531,869.86元，属于第二层次的余额为20,160,013.64元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次517,810,271.40元，第二层次29,985,921.34元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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2020年06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(2019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) 其他

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	304,702,940.50	88.66
	其中：股票	304,702,940.50	88.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,988,943.00	5.23
	其中：债券	17,988,943.00	5.23
	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	10,167,472.21	2.96
8	其他各项资产	10,810,580.04	3.15
9	合计	343,669,935.75	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,280,837.15	0.38
B	采矿业	5,091,107.27	1.51
C	制造业	195,438,230.78	58.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,672,865.32	1.39
E	建筑业	8,996,428.16	2.67
F	批发和零售业	6,868,571.74	2.04

G	交通运输、仓储和邮政业	3,758,054.08	1.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,146,182.13	13.41
J	金融业	6,357,910.00	1.89
K	房地产业	6,715,991.80	2.00
L	租赁和商务服务业	1,622,823.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	7,425,629.50	2.21
N	水利、环境和公共设施管理业	8,223,042.17	2.44
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	1,287,310.40	0.38
S	综合	1,817,957.00	0.54
	合计	304,702,940.50	90.54

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	300502	新易盛	49,580	3,129,489.60	0.93
2	300451	创业慧康	164,891	3,048,834.59	0.91
3	300699	光威复材	48,480	3,041,150.40	0.90
4	603345	安井食品	25,500	3,009,000.00	0.89
5	002791	坚朗五金	30,900	2,907,381.00	0.86
6	300346	南大光电	66,700	2,876,104.00	0.85
7	300036	超图软件	112,938	2,843,778.84	0.84
8	300226	上海钢联	34,663	2,724,511.80	0.81
9	002912	中新赛克	16,587	2,713,467.33	0.81

10	002216	三全食品	113,400	2,710,260.00	0.81
11	300709	精研科技	28,178	2,709,314.70	0.81
12	600206	有研新材	192,300	2,686,431.00	0.80
13	300236	上海新阳	44,100	2,648,646.00	0.79
14	300666	江丰电子	43,941	2,622,398.88	0.78
15	300659	中孚信息	42,340	2,541,246.80	0.76
16	600552	凯盛科技	390,900	2,540,850.00	0.75
17	300602	飞荣达	75,694	2,484,277.08	0.74
18	601137	博威合金	157,300	2,460,172.00	0.73
19	300429	强力新材	136,900	2,447,772.00	0.73
20	600210	紫江企业	565,810	2,427,324.90	0.72
21	300248	新开普	195,753	2,419,507.08	0.72
22	300037	新宙邦	43,810	2,412,178.60	0.72
23	603609	禾丰牧业	158,600	2,363,140.00	0.70
24	300552	万集科技	54,820	2,334,235.60	0.69
25	300183	东软载波	146,994	2,306,335.86	0.69
26	002847	盐津铺子	23,900	2,275,758.00	0.68
27	002636	金安国纪	248,800	2,266,568.00	0.67
28	300533	冰川网络	62,205	2,250,576.90	0.67
29	002267	陕天然气	366,400	2,238,704.00	0.67
30	300068	南都电源	209,410	2,232,310.60	0.66
31	601163	三角轮胎	168,400	2,229,616.00	0.66
32	300726	宏达电子	80,100	2,227,581.00	0.66
33	000915	山大华特	67,900	2,223,725.00	0.66
34	000965	天保基建	676,900	2,199,925.00	0.65
35	600063	皖维高新	673,500	2,195,610.00	0.65
36	300737	科顺股份	110,600	2,182,138.00	0.65
37	300639	凯普生物	41,600	2,160,288.00	0.64
38	600846	同济科技	253,700	2,156,450.00	0.64
39	300059	东方财富	106,040	2,142,008.00	0.64
40	300482	万孚生物	20,495	2,131,480.00	0.63

41	300760	迈瑞医疗	6,972	2,131,340.40	0.63
42	601058	赛轮轮胎	603,500	2,130,355.00	0.63
43	600764	中国海防	84,124	2,128,337.20	0.63
44	603315	福鞍股份	162,400	2,120,944.00	0.63
45	300759	康龙化成	21,553	2,120,815.20	0.63
46	603007	花王股份	335,050	2,110,815.00	0.63
47	002393	力生制药	79,987	2,109,257.19	0.63
48	600809	山西汾酒	14,432	2,092,640.00	0.62
49	300558	贝达药业	14,882	2,083,182.36	0.62
50	300066	三川智慧	423,300	2,082,636.00	0.62
51	000555	神州信息	135,200	2,079,376.00	0.62
52	300566	激智科技	77,700	2,049,726.00	0.61
53	002697	红旗连锁	186,300	2,034,396.00	0.60
54	002715	登云股份	76,700	2,024,880.00	0.60
55	603368	柳药股份	88,100	2,021,895.00	0.60
56	002148	北纬科技	395,084	2,003,075.88	0.60
57	300259	新天科技	346,000	1,999,880.00	0.59
58	000550	江铃汽车	156,300	1,933,431.00	0.57
59	002034	旺能环境	110,200	1,921,888.00	0.57
60	300692	中环环保	151,761	1,906,118.16	0.57
61	000876	新希望	63,700	1,898,260.00	0.56
62	300563	神宇股份	57,700	1,888,521.00	0.56
63	300750	宁德时代	10,700	1,865,652.00	0.55
64	000722	湖南发展	316,300	1,863,007.00	0.55
65	603612	索通发展	162,100	1,851,182.00	0.55
66	600455	博通股份	79,700	1,817,957.00	0.54
67	300319	麦捷科技	162,700	1,807,597.00	0.54
68	300191	潜能恒信	96,500	1,798,760.00	0.53
69	300172	中电环保	375,073	1,789,098.21	0.53
70	603579	荣泰健康	66,570	1,785,407.40	0.53
71	300715	凯伦股份	47,670	1,777,137.60	0.53

72	600926	杭州银行	196,300	1,750,996.00	0.52
73	000928	中钢国际	442,800	1,740,204.00	0.52
74	300328	宜安科技	143,383	1,716,294.51	0.51
75	600583	海油工程	374,225	1,702,723.75	0.51
76	600378	昊华科技	83,100	1,702,719.00	0.51
77	601677	明泰铝业	194,400	1,687,392.00	0.50
78	300636	同和药业	41,900	1,677,257.00	0.50
79	603398	邦宝益智	187,648	1,656,931.84	0.49
80	603060	国检集团	80,940	1,617,990.60	0.48
81	603127	昭衍新药	15,330	1,611,642.90	0.48
82	300655	晶瑞股份	39,000	1,604,850.00	0.48
83	300520	科大国创	84,500	1,562,405.00	0.46
84	002664	长鹰信质	116,900	1,545,418.00	0.46
85	000034	神州数码	60,326	1,468,334.84	0.44
86	600760	中航沈飞	44,400	1,457,208.00	0.43
87	300114	中航电测	127,700	1,457,057.00	0.43
88	603018	中设集团	149,260	1,452,299.80	0.43
89	600893	航发动力	60,700	1,425,236.00	0.42
90	300702	天宇股份	13,092	1,391,941.44	0.41
91	603586	金麒麟	85,900	1,363,233.00	0.41
92	300596	利安隆	38,600	1,344,438.00	0.40
93	603169	兰石重装	312,300	1,305,414.00	0.39
94	300607	拓斯达	32,080	1,305,335.20	0.39
95	600894	广日股份	187,600	1,285,060.00	0.38
96	002106	莱宝高科	96,800	1,271,952.00	0.38
97	300348	长亮科技	66,400	1,261,600.00	0.37
98	600717	天津港	283,960	1,255,103.20	0.37
99	002683	宏大爆破	35,600	1,242,440.00	0.37
100	603520	司太立	14,300	1,202,058.00	0.36
101	603367	辰欣药业	73,900	1,194,963.00	0.36
102	603588	高能环境	102,300	1,192,818.00	0.35

103	002298	中电兴发	145,700	1,184,541.00	0.35
104	002777	久远银海	38,626	1,174,616.66	0.35
105	300682	朗新科技	68,350	1,163,317.00	0.35
106	002016	世荣兆业	175,800	1,149,732.00	0.34
107	300388	国祯环保	124,440	1,147,336.80	0.34
108	601588	北辰实业	401,300	1,127,653.00	0.34
109	603063	禾望电气	158,100	1,125,672.00	0.33
110	300672	国科微	21,500	1,105,315.00	0.33
111	300724	捷佳伟创	12,408	1,098,480.24	0.33
112	300055	万邦达	176,306	1,078,992.72	0.32
113	002705	新宝股份	29,085	1,061,020.80	0.32
114	300474	景嘉微	15,300	1,029,690.00	0.31
115	000666	经纬纺机	110,600	1,002,036.00	0.30
116	300677	英科医疗	7,800	996,840.00	0.30
117	002218	拓日新能	267,200	975,280.00	0.29
118	300559	佳发教育	43,771	928,820.62	0.28
119	300119	瑞普生物	41,400	925,290.00	0.27
120	002262	恩华药业	54,300	915,498.00	0.27
121	002557	洽洽食品	16,800	910,392.00	0.27
122	300571	平治信息	19,400	896,280.00	0.27
123	002335	科华恒盛	40,400	852,036.00	0.25
124	300613	富瀚微	7,420	840,686.00	0.25
125	603596	伯特利	23,755	836,176.00	0.25
126	002686	亿利达	161,240	822,324.00	0.24
127	603773	沃格光电	25,200	820,764.00	0.24
128	002567	唐人神	85,800	816,816.00	0.24
129	300628	亿联网络	11,800	805,468.00	0.24
130	002130	沃尔核材	175,900	803,863.00	0.24
131	002332	仙琚制药	46,800	788,112.00	0.23
132	300379	东方通	18,100	778,843.00	0.23
133	000719	中原传媒	111,900	778,824.00	0.23

134	002100	天康生物	48,200	776,020.00	0.23
135	002714	牧原股份	9,450	774,900.00	0.23
136	002568	百润股份	16,800	761,376.00	0.23
137	603078	江化微	16,659	748,822.05	0.22
138	600529	山东药玻	12,867	746,286.00	0.22
139	300476	胜宏科技	30,560	734,968.00	0.22
140	000811	冰轮环境	117,300	734,298.00	0.22
141	300240	飞力达	135,800	718,382.00	0.21
142	300378	鼎捷软件	52,100	708,560.00	0.21
143	600496	精工钢构	210,100	703,835.00	0.21
144	601818	光大银行	191,700	686,286.00	0.20
145	000056	皇庭国际	172,100	681,516.00	0.20
146	600773	西藏城投	113,600	674,784.00	0.20
147	300674	宇信科技	15,596	672,967.40	0.20
148	002512	达华智能	133,200	672,660.00	0.20
149	002214	大立科技	23,700	667,866.00	0.20
150	600419	天润乳业	44,700	652,173.00	0.19
151	000403	双林生物	8,716	646,117.08	0.19
152	603040	新坐标	21,920	637,872.00	0.19
153	002901	大博医疗	5,300	632,237.00	0.19
154	300188	美亚柏科	31,100	616,713.00	0.18
155	002133	广宇集团	202,700	616,208.00	0.18
156	300363	博腾股份	17,300	597,888.00	0.18
157	300360	炬华科技	61,080	593,697.60	0.18
158	002706	良信电器	35,400	590,472.00	0.18
159	002647	仁东控股	16,600	588,968.00	0.18
160	600459	贵研铂业	19,700	587,257.00	0.17
161	600612	老凤祥	11,700	563,823.00	0.17
162	002595	豪迈科技	28,868	561,771.28	0.17
163	600876	洛阳玻璃	41,500	561,495.00	0.17
164	002063	远光软件	43,700	551,931.00	0.16

165	300458	全志科技	14,862	546,921.60	0.16
166	002362	汉王科技	30,400	542,032.00	0.16
167	300256	星星科技	83,739	530,905.26	0.16
168	600590	泰豪科技	97,700	526,603.00	0.16
169	603313	梦百合	22,180	521,895.40	0.16
170	000733	振华科技	23,200	521,768.00	0.16
171	688505	复旦张江	20,896	517,802.88	0.15
172	000503	国新健康	46,000	512,440.00	0.15
173	600710	苏美达	116,000	503,440.00	0.15
174	603678	火炬电子	17,855	500,297.10	0.15
175	002389	航天彩虹	36,576	491,947.20	0.15
176	300061	旗天科技	81,500	491,445.00	0.15
177	603365	水星家纺	33,600	484,848.00	0.14
178	002851	麦格米特	18,200	471,744.00	0.14
179	300627	华测导航	23,180	471,713.00	0.14
180	000591	太阳能	137,100	463,398.00	0.14
181	300185	通裕重工	228,250	447,370.00	0.13
182	603733	仙鹤股份	27,800	446,746.00	0.13
183	300170	汉得信息	46,400	446,368.00	0.13
184	603167	渤海轮渡	54,400	426,496.00	0.13
185	300676	华大基因	2,700	420,957.00	0.13
186	300238	冠昊生物	23,600	420,316.00	0.12
187	002626	金达威	16,100	417,956.00	0.12
188	300327	中颖电子	12,870	416,988.00	0.12
189	300373	扬杰科技	12,296	412,161.92	0.12
190	002467	二六三	58,600	411,958.00	0.12
191	300394	天孚通信	6,600	393,030.00	0.12
192	600456	宝钛股份	14,357	392,663.95	0.12
193	600756	浪潮软件	20,900	386,650.00	0.11
194	002254	泰和新材	28,300	384,880.00	0.11
195	300076	GQY视讯	78,800	384,544.00	0.11

196	300653	正海生物	4,950	382,239.00	0.11
197	300623	捷捷微电	12,620	379,231.00	0.11
198	603258	电魂网络	6,700	372,252.00	0.11
199	300038	数知科技	45,500	371,280.00	0.11
200	002091	江苏国泰	60,800	367,840.00	0.11
201	600320	振华重工	127,800	366,786.00	0.11
202	002194	武汉凡谷	17,400	360,180.00	0.11
203	002484	江海股份	38,600	357,822.00	0.11
204	600363	联创光电	22,900	354,721.00	0.11
205	000921	海信家电	29,100	353,856.00	0.11
206	002430	杭氧股份	24,800	352,160.00	0.10
207	603118	共进股份	29,500	350,755.00	0.10
208	600587	新华医疗	22,487	349,897.72	0.10
209	002531	天顺风能	58,100	347,438.00	0.10
210	603208	江山欧派	3,560	346,744.00	0.10
211	000976	华铁股份	61,400	342,612.00	0.10
212	000810	创维数字	28,100	339,448.00	0.10
213	600422	昆药集团	34,500	336,720.00	0.10
214	000823	超声电子	24,200	336,622.00	0.10
215	002145	中核钛白	72,800	329,056.00	0.10
216	600761	安徽合力	33,600	323,904.00	0.10
217	002312	三泰控股	71,100	323,505.00	0.10
218	002459	晶澳科技	17,200	323,016.00	0.10
219	600284	浦东建设	51,100	314,265.00	0.09
220	300326	凯利泰	10,645	309,769.50	0.09
221	603583	捷昌驱动	4,507	308,188.66	0.09
222	300287	飞利信	74,100	307,515.00	0.09
223	000933	神火股份	73,700	305,855.00	0.09
224	300761	立华股份	7,885	303,887.90	0.09
225	002139	拓邦股份	53,200	299,516.00	0.09
226	603005	晶方科技	3,800	298,908.00	0.09

227	002733	雄韬股份	13,900	295,375.00	0.09
228	300741	华宝股份	8,000	295,040.00	0.09
229	300638	广和通	4,900	294,490.00	0.09
230	603533	掌阅科技	7,700	293,601.00	0.09
231	600114	东睦股份	27,800	288,564.00	0.09
232	600742	一汽富维	34,840	286,384.80	0.09
233	002182	云海金属	29,800	284,292.00	0.08
234	300101	振芯科技	25,200	278,460.00	0.08
235	002611	东方精工	59,800	275,678.00	0.08
236	688186	广大特材	8,033	274,326.95	0.08
237	002747	埃斯顿	22,900	273,884.00	0.08
238	603666	亿嘉和	3,120	273,811.20	0.08
239	600285	羚锐制药	29,210	273,113.50	0.08
240	603686	龙马环卫	11,200	272,944.00	0.08
241	002657	中科金财	17,400	270,222.00	0.08
242	300229	拓尔思	23,500	269,780.00	0.08
243	000951	中国重汽	8,600	268,836.00	0.08
244	002443	金洲管道	39,000	265,590.00	0.08
245	600510	黑牡丹	33,700	265,556.00	0.08
246	600611	大众交通	70,484	265,019.84	0.08
247	600269	赣粤高速	75,300	262,797.00	0.08
248	603113	金能科技	22,100	262,769.00	0.08
249	300662	科锐国际	5,900	262,550.00	0.08
250	603363	傲农生物	11,200	261,744.00	0.08
251	000926	福星股份	49,000	257,250.00	0.08
252	300075	数字政通	19,400	257,050.00	0.08
253	600308	华泰股份	52,700	242,420.00	0.07
254	002318	久立特材	32,600	237,980.00	0.07
255	600449	宁夏建材	19,100	233,402.00	0.07
256	300684	中石科技	6,700	232,490.00	0.07
257	000801	四川九洲	39,600	231,264.00	0.07

258	002309	中利集团	41,600	228,800.00	0.07
259	000726	鲁泰 A	30,100	228,158.00	0.07
260	000507	珠海港	42,521	222,810.04	0.07
261	002067	景兴纸业	71,600	217,664.00	0.06
262	600217	中再资环	44,800	215,936.00	0.06
263	002726	龙大肉食	25,500	215,220.00	0.06
264	002322	理工环科	17,900	213,368.00	0.06
265	300390	天华超净	15,200	211,736.00	0.06
266	601001	大同煤业	53,928	211,397.76	0.06
267	600571	信雅达	22,700	206,343.00	0.06
268	600020	中原高速	57,700	204,258.00	0.06
269	603383	顶点软件	4,560	203,330.40	0.06
270	002746	仙坛股份	15,249	202,049.25	0.06
271	300081	恒信东方	23,700	201,924.00	0.06
272	603180	金牌厨柜	4,240	200,043.20	0.06
273	002095	生意宝	9,900	199,980.00	0.06
274	300110	华仁药业	48,600	199,260.00	0.06
275	002947	恒铭达	3,100	198,400.00	0.06
276	300409	道氏技术	17,600	197,472.00	0.06
277	000797	中国武夷	50,600	193,292.00	0.06
278	300083	劲胜智能	32,175	190,476.00	0.06
279	002518	科士达	15,300	189,720.00	0.06
280	603008	喜临门	17,600	188,848.00	0.06
281	300096	易联众	22,200	188,034.00	0.06
282	000958	东方能源	45,100	187,616.00	0.06
283	000751	锌业股份	72,700	187,566.00	0.06
284	601330	绿色动力	19,500	185,250.00	0.06
285	600987	航民股份	34,500	184,575.00	0.05
286	601949	中国出版	35,100	184,275.00	0.05
287	300624	万兴科技	2,280	183,540.00	0.05
288	002462	嘉事堂	13,400	182,508.00	0.05

289	002519	银河电子	43,600	180,940.00	0.05
290	688004	博汇科技	2,500	179,750.00	0.05
291	300255	常山药业	30,800	177,716.00	0.05
292	600351	亚宝药业	34,600	176,114.00	0.05
293	600389	江山股份	9,500	173,755.00	0.05
294	002245	澳洋顺昌	44,200	171,054.00	0.05
295	600775	南京熊猫	20,600	168,714.00	0.05
296	600229	城市传媒	22,400	166,208.00	0.05
297	600090	*ST济堂	56,701	164,432.90	0.05
298	603658	安图生物	1,000	162,440.00	0.05
299	603587	地素时尚	9,369	157,867.65	0.05
300	002542	中化岩土	46,400	157,760.00	0.05
301	603980	吉华集团	22,600	157,522.00	0.05
302	002060	粤水电	54,200	156,638.00	0.05
303	300208	青岛中程	24,700	155,116.00	0.05
304	002685	华东重机	26,100	153,990.00	0.05
305	000815	美利云	22,500	151,875.00	0.05
306	300723	一品红	3,400	146,506.00	0.04
307	603466	风语筑	7,500	146,025.00	0.04
308	000065	北方国际	19,800	144,738.00	0.04
309	300487	蓝晓科技	4,400	144,672.00	0.04
310	300457	赢合科技	4,500	143,460.00	0.04
311	603105	芯能科技	16,100	141,519.00	0.04
312	000498	山东路桥	28,900	140,165.00	0.04
313	600343	航天动力	17,900	138,904.00	0.04
314	603920	世运电路	5,600	138,824.00	0.04
315	603727	博迈科	7,600	134,900.00	0.04
316	002585	双星新材	20,700	130,203.00	0.04
317	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.04
318	002232	启明信息	13,200	129,492.00	0.04
319	000885	城发环境	12,800	127,872.00	0.04

320	600546	山煤国际	10,700	125,725.00	0.04
321	603896	寿仙谷	3,700	125,356.00	0.04
322	603006	黎明股份	12,300	124,722.00	0.04
323	300237	美晨生态	56,700	121,905.00	0.04
324	000821	京山轻机	20,700	120,060.00	0.04
325	300206	理邦仪器	6,300	114,912.00	0.03
326	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.03
327	300401	花园生物	7,500	107,475.00	0.03
328	002609	捷顺科技	8,400	107,100.00	0.03
329	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.03
330	603648	畅联股份	11,900	104,720.00	0.03
331	603713	密尔克卫	1,000	104,020.00	0.03
332	002617	露笑科技	21,300	103,518.00	0.03
333	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
334	002429	兆驰股份	20,000	99,000.00	0.03
335	300179	四方达	17,400	98,658.00	0.03
336	603839	安正时尚	7,700	97,790.00	0.03
337	002651	利君股份	19,900	96,316.00	0.03
338	688096	京源环保	4,485	96,068.70	0.03
339	001896	豫能控股	29,500	94,990.00	0.03
340	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.03
341	600295	鄂尔多斯	13,000	91,650.00	0.03
342	002708	光洋股份	14,300	90,805.00	0.03
343	002346	柘中股份	9,000	88,470.00	0.03
344	000514	渝开发	22,200	84,804.00	0.03
345	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.03
346	603117	万林物流	23,200	82,592.00	0.02
347	002539	云图控股	11,100	76,590.00	0.02
348	000036	华联控股	17,400	76,560.00	0.02
349	600477	杭萧钢构	20,800	75,504.00	0.02
350	300506	名家汇	14,600	73,292.00	0.02

351	002301	齐心集团	4,300	70,606.00	0.02
352	002377	国创高新	17,900	69,989.00	0.02
353	002460	赣锋锂业	1,300	69,641.00	0.02
354	300725	药石科技	500	62,125.00	0.02
355	300735	光弘科技	3,220	59,409.00	0.02
356	601369	陕鼓动力	9,400	59,126.00	0.02
357	603081	大丰实业	4,400	49,676.00	0.01
358	300664	鹏鹞环保	5,100	47,073.00	0.01
359	600499	科达洁能	11,200	46,144.00	0.01
360	002850	科达利	600	41,520.00	0.01
361	300462	华铭智能	1,500	34,020.00	0.01
362	603359	东珠生态	2,000	33,460.00	0.01
363	002433	太安堂	7,500	32,850.00	0.01
364	300205	天喻信息	3,000	31,200.00	0.01
365	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
366	002135	东南网架	2,900	21,315.00	0.01
367	002798	帝欧家居	600	19,482.00	0.01
368	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
369	300454	深信服	65	13,387.40	0.00
370	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
371	002343	慈文传媒	1,380	11,978.40	0.00
372	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
373	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
374	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
375	300601	康泰生物	49	7,945.84	0.00
376	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
377	002787	华源控股	1,100	7,172.00	0.00
378	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
379	600745	闻泰科技	50	6,297.50	0.00
380	300523	辰安科技	90	4,215.60	0.00
381	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

382	603027	千禾味业	76	2,400.08	0.00
383	002840	华统股份	50	947.00	0.00
384	600720	祁连山	50	812.50	0.00
385	300294	博雅生物	19	712.31	0.00
386	000901	航天科技	57	580.83	0.00
387	603979	金诚信	56	577.36	0.00
388	600771	广誉远	40	561.20	0.00
389	002035	华帝股份	53	536.89	0.00
390	000030	富奥股份	80	511.20	0.00
391	300393	中来股份	48	320.64	0.00
392	600491	龙元建设	36	311.04	0.00
393	000913	钱江摩托	23	309.81	0.00
394	600711	盛屯矿业	60	308.40	0.00
395	000989	九芝堂	30	302.40	0.00
396	002326	永太科技	24	294.24	0.00
397	002283	天润工业	63	274.05	0.00
398	002376	新北洋	24	244.56	0.00
399	002320	海峡股份	22	242.00	0.00
400	600658	电子城	40	238.80	0.00
401	002307	北新路桥	40	238.40	0.00
402	300696	爱乐达	6	215.28	0.00
403	600172	黄河旋风	77	211.75	0.00
404	300560	中富通	10	200.80	0.00
405	002910	庄园牧场	18	187.02	0.00
406	603901	永创智能	23	163.76	0.00
407	002837	英维克	3	88.86	0.00
408	600252	中恒集团	18	57.78	0.00
409	002097	山河智能	2	11.94	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	300552	万集科技	6,176,637.40	1.09
2	600276	恒瑞医药	5,526,963.00	0.98
3	300114	中航电测	4,732,418.00	0.84
4	000719	中原传媒	4,321,271.00	0.77
5	300226	上海钢联	4,304,688.06	0.76
6	603007	花王股份	4,272,301.00	0.76
7	300659	中孚信息	4,150,325.00	0.73
8	600529	山东药玻	3,981,861.40	0.71
9	300209	天泽信息	3,964,062.00	0.70
10	603986	兆易创新	3,919,836.92	0.69
11	603733	仙鹤股份	3,885,856.00	0.69
12	300759	康龙化成	3,870,602.68	0.69
13	300096	易联众	3,789,206.00	0.67
14	603113	金能科技	3,777,324.00	0.67
15	002628	成都路桥	3,753,572.50	0.66
16	601298	青岛港	3,731,859.00	0.66
17	603368	柳药股份	3,681,698.00	0.65
18	603035	常熟汽饰	3,640,863.00	0.64
19	000035	中国天楹	3,617,542.00	0.64
20	603890	春秋电子	3,608,827.00	0.64

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	603986	兆易创新	8,825,147.75	1.56
2	300326	凯利泰	8,007,558.22	1.42

3	300347	泰格医药	7,708,794.42	1.36
4	000661	长春高新	6,221,272.00	1.10
5	300291	华录百纳	6,042,128.44	1.07
6	300118	东方日升	5,939,699.12	1.05
7	600276	恒瑞医药	5,916,735.42	1.05
8	300397	天和防务	5,484,686.00	0.97
9	002481	双塔食品	5,409,476.75	0.96
10	300533	冰川网络	5,020,425.40	0.89
11	300393	中来股份	4,949,277.21	0.88
12	002402	和而泰	4,776,845.00	0.85
13	300634	彩讯股份	4,762,297.00	0.84
14	300726	宏达电子	4,732,122.00	0.84
15	603283	赛腾股份	4,695,980.00	0.83
16	002123	梦网集团	4,624,276.00	0.82
17	300377	赢时胜	4,612,303.10	0.82
18	300209	天泽信息	4,560,866.00	0.81
19	002240	威华股份	4,537,612.92	0.80
20	002308	威创股份	4,511,287.35	0.80

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	886,289,441.19
卖出股票收入（成交）总额	1,185,154,140.31

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	17,988,943.00	5.35

	其中：政策性金融债	17,988,943.00	5.35
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	17,988,943.00	5.35

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	018007	国开1801	179,620	17,988,943.00	5.35

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
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-

股指期货投资本期收益（元）	633,902.91
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-167,400.00

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。本半年度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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 量化多因子是一只利用多因子选股模型以及风险模型和优化器进行量化投资的基金。上海钢联的公司高级管理人员在2020年1月3号违规进行了减持，公司之后发布了道歉公告。这次因为对减持规则理解错误造成的违规减持涉及的金额仅10万余元，影响非常有限。经过综合评估，我们认为上海钢联仍然具备投资价值，因此继续持有该只股票。

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	98,235.65
2	应收证券清算款	9,821,995.76
3	应收股利	-

4	应收利息	575,858.13
5	应收申购款	314,490.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,810,580.04

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

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
创金合信量化多因子股票A	15,339	15,693.30	8,196.52	0.00%	240,711,364.50	100.00%
创金合信量化多因子股票C	1,180	2,203.23	0.00	0.00%	2,599,811.06	100.00%

合计	16,443	14,797.75	8,196.52	0.00%	243,311,175.56	100.00%
----	--------	-----------	----------	-------	----------------	---------

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	创金合信量化多因子股票A	58,215.12	0.02%
	创金合信量化多因子股票C	9.00	0.00%
	合计	58,224.12	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	创金合信量化多因子股票A	0~10
	创金合信量化多因子股票C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信量化多因子股票A	0
	创金合信量化多因子股票C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C
基金合同生效日(2016年01月22日)基金份额总额	202,639,215.47	1,489,891,025.73

本报告期期初基金份额总额	483,239,360.48	3,628,120.81
本报告期基金总申购份额	14,193,534.06	2,769,782.41
减：本报告期基金总赎回份额	256,713,333.52	3,798,092.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	240,719,561.02	2,599,811.06

§ 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，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

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，未出现管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

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	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	佣金	占当期佣金总	

	数量		的比例		例	
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	297,792,238.70	14.45%	65,220.31	8.55%	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	1,289.84	0.00%	0.40	0.00%	-
东吴证券	2	432,719,515.60	21.00%	137,717.56	18.05%	-
东兴证券	2	208,184,273.45	10.10%	66,181.24	8.68%	-
方正证券	2	273,406,265.47	13.27%	114,526.12	15.01%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	131,168,321.44	6.36%	54,837.04	7.19%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰	2	-	-	-	-	-

证券						
金元 证券	2	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
银河 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
中金 公司	2	139,321,457.34	6.76%	58,344.01	7.65%	-
中投 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	213,177,356.53	10.34%	89,385.37	11.72%	-
中银 国际 证券	2	-	-	-	-	-
安信 证券	4	-	-	-	-	-
太平 洋证	4	365,111,057.00	17.72%	176,582.57	23.15%	-

券						
中泰 证券	4	-	-	-	-	-
中信 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中泰证券的2个交易单元，退租广发证券、安信证券的3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
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	301,650.00	2.49%	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	8,306,218.60	68.66%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
广州证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	467,691.40	3.87%	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东 方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	3,022,800.00	24.99%	1,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 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	创金合信量化多因子股票型证券投资基金2019年第四季度报告	公司官网、证券时报	2020-01-17
2	创金合信量化多因子股票型证券投资基金2020年第一季度报告	公司官网、证券时报	2020-04-21
3	创金合信量化多因子股票型证券投资基金2019年年度报告	公司官网、证券时报	2020-04-30

§ 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，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、《创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信量化多因子股票型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信量化多因子股票型证券投资基金2020年中期报告原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司
二〇二〇年八月三十一日

