

创金合信量化多因子股票型证券投资基金2016年半年度报告

2016年6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：2016年8月26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2016年8月19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2016年01月22日起至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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
§11 备查文件目录.....	54
11.1 备查文件目录.....	55
11.2 存放地点.....	55
11.3 查阅方式.....	55

§ 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1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	111,016,480.77份
基金合同存续期	不定期

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	<p>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。</p> <p>本基金股票投资组合的构建以国际通行的多因子模型为基础框架，并根据风险约束、交易成本、投资限制等时机情况的需要进行优化。即，本基金股票组合的构建包括多因子模型和投资组合优化两个部分。在保证基金流动性的前提下，积极把握投资机会，获取收益。</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率×90%+2%
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。

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	北京市西城区复兴门内大街 55号
办公地址	深圳市福田区福华一路 115号投行大厦15层	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码	518000	100140
法定代表人	刘学民	姜建清

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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼
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楼
基金保证人		

§ 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（2016年1月22日至2016年6月30日）
本期已实现收益	8,229,690.53
本期利润	10,702,186.72
加权平均基金份额本期利润	0.1287
本期加权平均净值利润率	12.11%
本期基金份额净值增长率	12.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	13,105,107.08
期末可供分配基金份额利润	0.1180
期末基金资产净值	124,565,366.11
期末基金份额净值	1.122
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	12.20%

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，表中的"期末"均指报告期最后一日，即6月30日。

4.本基金合同生效日为2016年1月22日，截至报告期末，本基金成立不满半年。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

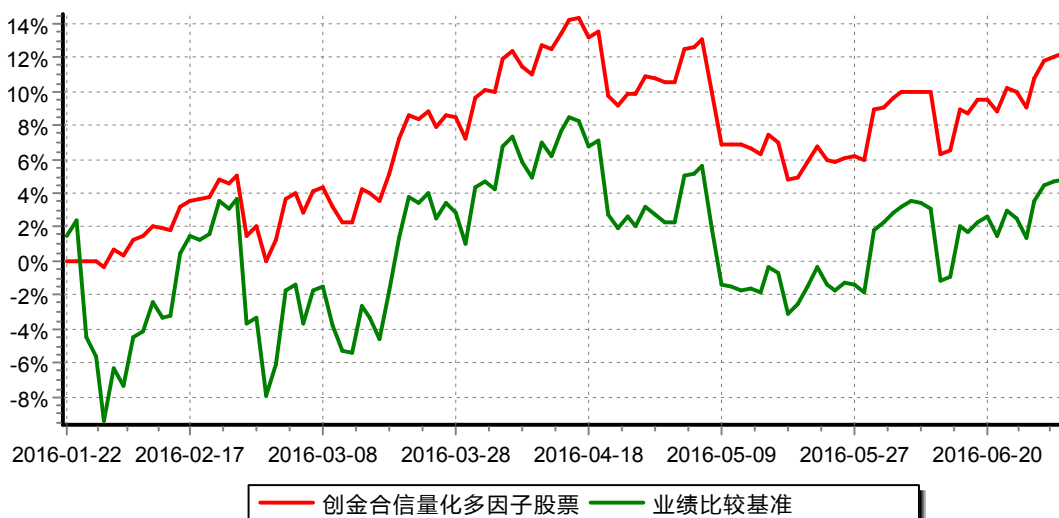
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.03%	1.10%	2.85%	1.39%	0.18%	-0.29%
过去三个月	1.91%	1.14%	0.10%	1.49%	1.81%	-0.35%
自基金合同生效日起 至今（2016年01月22 日-2016年06月30日）	12.20%	1.12%	4.77%	1.98%	7.43%	-0.86%

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日正式注册成立，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6只公募基金。截至2016年6月30日，本公司共管理13只公募基金，其中混合型产品4只、指数型产品2只、债券型产品5只、股票型产品1只、货币

型产品1只；管理的公募基金规模约68亿元。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程志田	基金经理、量化投资部总监	2016年1月22日	—	9	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。
庞世恩	基金经理	2016年1月25日	—	5	庞世恩先生，中国国籍，中国人民大学理学硕士。2011年7月加入泰康资产管理有限责任公司，历任金融工程助理研究员、金融工程研究经理、金融工程研究高级经理、金融工程研究总监、执行投资经理。2015年9月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。

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

2、证券从业年限计算的起止时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同》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

本报告期内，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）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工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。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现异常交易情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

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2016年上半年，年初受投资者恐慌情绪以及熔断引起的流动性匮乏影响，一月份A股经历了一轮恐慌性下跌，之后股市以震荡反弹为主，投资者情绪在二季度震荡筑底的过程中慢慢修复；另一方面，部分优质个股已经在二季度获得不错的涨幅，显示投资者信心在恢复；另外，受供给侧改革影响，相关行业受益，其中个股股价表现具备超额收益。

在投资管理上，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，多因子选股模型提供了持续稳健的Alpha；另一方面，量化择时模型准确把握了一月底和二月底两次抄底机会。本基金稳健运行，在有效控制回撤的同时，获得了较为可观的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金净值增长率12.2%，同期业绩比较基准收益率为4.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，A股市场在1季度的调整使风险得到了一定的释放，市场大部分的悲观预期已经充分反映，目前市场点位下具有较大的安全边际；在货币宽松的大环境下，人民币汇率也相对企稳，宏观经济企稳的可能性增大，市场有望迎来修复性行情。部分低估值大盘蓝筹股以及绩优成长股仍然具备投资价值，同时看好“深港通”等主题投资机会。综合来看，下半年市场可能呈现震荡上行走势。

看好的版块，一是涉及供给侧改革的行业，如有色钢铁水泥等，二是去年跌幅较大的创业板等中小股票，三是主题投资机会，如深港通等。供给侧改革是一个势在必行的改革，对国家修正产能过剩，减小无效投资有相当的正面意义，反应在资本市场是有些行业和公司将会得到重新估值，带来重估的机会；而创业板等代表经济转型的公司代表了中国经济的未来，这一逻辑将会贯穿未来很长时间，特别是经历了充分调整之后；主题投资也是贯穿未来一段时间的投资热点，可密切关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

本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2016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：创金合信量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	16,839,900.93
结算备付金		1,672,739.78
存出保证金		30,709.13
交易性金融资产	6.4.7.2	105,998,921.05
其中：股票投资		105,998,921.05
基金投资		—

债券投资		—
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		—
应收利息	6.4.7.5	2,749.07
应收股利		—
应收申购款		3,205,096.37
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		127,750,116.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30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		1,974,736.94
应付赎回款		807,351.22
应付管理人报酬		113,199.24
应付托管费		18,866.56
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	199,125.11
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	71,471.15

负债合计		3,184,750.22
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	111,016,480.77
未分配利润	6.4.7.10	13,548,885.34
所有者权益合计		124,565,366.11
负债和所有者权益总计		127,750,116.33

注：1.报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.122元，基金份额总额111,016,480.77份。

2.本财务报表的实际编制期间为2016年1月22日(基金合同生效日)至2016年6月30日。

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：2016年1月22日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2016年1月22日至2016年6月30日
一、收入		11,895,294.16
1.利息收入		247,043.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	62,644.83
债券利息收入		—
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		184,398.80
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,919,422.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,447,134.27
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	—
贵金属投资收益		—

衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	472,288.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,472,496.19
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	1,256,331.85
减：二、费用		1,193,107.44
1. 管理人报酬		575,752.40
2. 托管费		95,958.76
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	450,946.70
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6.4.7.19	70,449.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,702,186.72
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,702,186.72

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：2016年1月22日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月22日至2016年6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)	202,639,215.47	—	202,639,215.47

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	10,702,186.72	10,702,186.72
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)	-91,622,734.70	2,846,698.62	-88,776,036.08
其中：1.基金申购款	95,837,134.61	9,468,374.72	105,305,509.33
2.基金赎回款	-187,459,869.31	-6,621,676.10	-194,081,545.41
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)	111,016,480.77	13,548,885.34	124,565,366.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至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《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500指数收益率×90%+2%。

本财务报表由本基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司于2016年8月25日批准报出。

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》、《创金合信量化多因子股票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

本基金2016年1月22日(基金合同生效日)至2016年6月30日止期间的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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月22日(基金合同生效日)至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2016年1月22日(基金合同生效日)至2016年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

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

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

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

2、金融负债的分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；3、每一基金份额享有同等分配权；4、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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，股权的股息、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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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 2016年6月30日
活期存款	16,839,900.93
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	16,839,900.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	103,526,424.86	105,998,921.05	2,472,496.19
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	103,526,424.86	105,998,921.05	2,472,496.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本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**

本基金于本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 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,982.57
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	752.70
应收债券利息	—
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	13.80
合计	2,749.07

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	199,125.11
银行间市场应付交易费用	—
合计	199,125.11

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,471.57
预提费用	69,999.58
合计	71,471.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月22日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	202,639,215.47	202,639,215.47
本期申购	95,837,134.61	95,837,134.61
本期赎回（以“-”号填列）	-187,459,869.31	-187,459,869.31
本期末	111,016,480.77	111,016,480.77

注：1、申购含红利再投、转换入份(金)额；赎回含转换出份(金)额。

2、本基金自2015年12月23日至2016年1月19日止期间公开发售，共募集有效净认购资金202,600,123.85元。根据《创金合信量化多因子股票型证券投资基金募集说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入39,091.62元，在本基金成立后，折算为39,091.62份基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 未分配利润

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
上年度末	—	—	—
本期利润	8,229,690.53	2,472,496.19	10,702,186.72
本期基金份额交易产生的变动数	4,875,416.55	-2,028,717.93	2,846,698.62
其中：基金申购款	9,111,515.94	356,858.78	9,468,374.72
基金赎回款	-4,236,099.39	-2,385,576.71	-6,621,676.10

本期已分配利润	—	—	—
本期末	13,105,107.08	443,778.26	13,548,885.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月22日至2016年6月30日
活期存款利息收入	48,987.04
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	13,525.38
其他	132.41
合计	62,644.83

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2016年1月22日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	7,447,134.27
股票投资收益——赎回差价 收入	—
合计	7,447,134.27

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月22日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	132,544,780.16
减：卖出股票成本总额	125,097,645.89
买卖股票差价收入	7,447,134.27

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

本基金于本期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金于本期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月22日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	472,288.22
基金投资产生的股利收益	—
合计	472,288.22

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月22日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	2,472,496.19
——股票投资	2,472,496.19
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	2,472,496.19

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月22日至2016年6月30日
基金赎回费收入	1,256,331.85
合计	1,256,331.85

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，对持有期少于30日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用全额计入基金财产；对持有期在30日以上（含）且少于90日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的75%计入基金财产；对持有期在90日以上（含）且少于180日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的50%计入基金财产；对持续持有期180日以上（含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的25%计入基金财产；。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月22日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	450,946.70
银行间市场交易费用	—
合计	450,946.70

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月22日至2016年6月30日
审计费用	27,999.51
信息披露费	42,000.07
帐户维护费	400.00
汇划手续费	50.00
合计	70,449.58

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，本基金并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，本基金并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(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东

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 2016年1月22日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券	121,038,725.98	33.51%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期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 2016年1月22日至2016年6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	87,235.84	30.46%	—	—

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。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2016年1月22日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券	1,149,000,000.00	67.99%

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 2016年1月22日至2016年6月30日	
	当期发生的基金应支付的管理费	575,752.40
其中：支付销售机构的客户维护费	320,378.48	

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值*1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月22日至2016年6月30日	

当期发生的基金应支付的托管费	95,958.76
----------------	-----------

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值*0.25%/当年天数。

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

无。

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

基金合同生效日（2016年1月22日）持有的基金份额	—
----------------------------	---

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

报告期末无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 2016年1月22日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行 活期存款	16,839,900.93	48,987.04

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

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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	期末 成本总额	期末 估值总额
600203	福日电子	2016-06-30	临时停牌	13.80	2016-07-01	13.25	38,400	423,518.59	529,920.00
600295	鄂尔多斯	2016-06-30	筹划非公开发行	7.89	2016-07-14	8.46	51,000	394,521.00	402,390.00
600860	京城股份	2016-06-27	重大事项	8.43	2016-07-05	8.85	37,700	332,517.07	317,811.00
002621	三垒股份	2016-06-20	重大事项	22.00	2016-07-04	21.00	14,200	246,809.90	312,400.00
000916	华北高速	2016-06-24	重大事项	5.01		—	58,800	266,220.29	294,588.00
600121	郑州煤电	2016-06-17	重大事项	4.80	2016-07-01	5.05	58,900	272,716.00	282,720.00
000639	西王食品	2016-05-27	重大事项	14.12		—	19,400	262,918.50	273,928.00
000498	山东路桥	2016-06-20	重大事项	5.76	2016-07-04	6.11	46,700	276,413.00	268,992.00
000407	胜利股份	2016-05-23	重大事项	6.73		—	38,700	256,063.60	260,451.00
600475	华光股份	2016-05-18	重大事项	14.85		—	15,800	222,911.39	234,630.00
002120	新海股份	2016-05-23	重大事项	20.48	2016-07-15	22.53	11,000	257,858.64	225,280.00
002101	广东鸿图	2016-04-29	重大事项	21.62		—	9,300	178,936.85	201,066.00
000636	风华高科	2016-03-15	重大事项	8.84	2016-07-13	9.72	20,700	157,919.16	182,988.00
000537	广宇发展	2016-04-13	重大资产重组	8.01	2016-07-20	8.81	21,500	146,577.53	172,215.00
300225	金力泰	2016-03-22	重大事项	7.12	2016-07-08	7.58	24,100	143,386.49	171,592.00
00244	壹桥	2016-	重大事项	7.19	2016-	7.16	22,50	142,103.23	161,775.00

7	海参	03-09			07-04		0		
600035	楚天高速	2016-04-11	重大事项	5.06	2016-08-01	5.57	30,700	161,175.00	155,342.00
000608	阳光股份	2016-03-08	重大事项	5.30	2016-07-14	5.12	29,300	144,429.18	155,290.00
000818	方大化工	2016-02-05	重大资产重组	6.57		—	21,000	119,214.00	137,970.00

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因重大事项可能产生重大影响被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金于本期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本期末未持有交易所市场债券正回购。

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中国工商银行，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。

截至2016年6月30日，本基金未持有债券投资。

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上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的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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发行的证券不得超过该证券的10%。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。

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 2016年6月 30日	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	16,839,900.93	—	—	—	—	—	16,839,900.93
结算备付金	1,672,739.78	—	—	—	—	—	1,672,739.78
存出保证金	30,709.13	—	—	—	—	—	30,709.13
交易性金融资产	—	—	—	—	—	105,998,921.05	105,998,921.05
应收利息	—	—	—	—	—	2,749.07	2,749.07
应收申购款	—	—	—	—	—	3,205,096.37	3,205,096.37
资产总计	18,543,349.84	—	—	—	—	109,206,766.49	127,750,116.33
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	1,974,736.94	1,974,736.94
应付赎回款	—	—	—	—	—	807,351.22	807,351.22
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	113,199.24	113,199.24
应付托管费	—	—	—	—	—	18,866.56	18,866.56
应付交易费用	—	—	—	—	—	199,125.11	199,125.11

其他负债	—	—	—	—	—	71,471.15	71,471.15
负债总计	—	—	—	—	—	3,184,750.22	3,184,750.22
利率敏感度缺口	18,543,349.84	—	—	—	—	106,022,016.27	124,565,366.11

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无。

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 2016年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	105,998,921.05	85.10
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—

合计	105,998,921.05	85.10
----	----------------	-------

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2016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101,257,573.05元，属于第二层次的余额为4,741,348.00元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	105,998,921.05	82.97
	其中：股票	105,998,921.05	82.97
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	18,512,640.71	14.49
7	其他各项资产	3,238,554.57	2.54
8	合计	127,750,116.33	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	161,775.00	0.13

B	采矿业	1,104,536.00	0.89
C	制造业	63,710,697.12	51.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,914,681.30	6.35
E	建筑业	3,156,197.20	2.53
F	批发和零售业	11,493,435.03	9.23
G	交通运输、仓储和邮政业	7,234,235.50	5.81
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	8,014,751.50	6.43
L	租赁和商务服务业	782,203.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	866,342.00	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	793,853.00	0.64
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	766,214.40	0.62
S	综合	—	—
	合计	105,998,921.05	85.10

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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	601313	江南嘉捷	36,700	531,416.00	0.43
2	600203	福日电子	38,400	529,920.00	0.43
3	002495	佳隆股份	67,200	510,720.00	0.41
4	300337	银邦股份	64,300	506,041.00	0.41
5	002003	伟星股份	32,300	504,849.00	0.41

6	002158	汉钟精机	40,300	496,899.00	0.40
7	002455	百川股份	50,300	495,958.00	0.40
8	002430	杭氧股份	53,300	495,690.00	0.40
9	000531	穗恒运 A	40,400	493,688.00	0.40
10	002255	海陆重工	56,900	489,909.00	0.39
11	601908	京运通	62,400	478,608.00	0.38
12	002194	武汉凡谷	37,333	477,115.74	0.38
13	600722	金牛化工	64,200	477,006.00	0.38
14	000903	云内动力	58,561	470,244.83	0.38
15	000939	凯迪生态	52,100	466,295.00	0.37
16	600345	长江通信	21,800	460,634.00	0.37
17	002116	中国海诚	30,800	457,688.00	0.37
18	002374	丽鹏股份	66,700	456,895.00	0.37
19	600681	百川能源	42,000	455,280.00	0.37
20	002472	双环传动	18,700	454,784.00	0.37
21	300382	斯莱克	12,100	454,718.00	0.37
22	600595	中孚实业	80,400	453,456.00	0.36
23	600308	华泰股份	92,700	452,376.00	0.36
24	002087	新野纺织	57,300	452,097.00	0.36
25	002397	梦洁股份	54,900	451,827.00	0.36
26	600243	青海华鼎	44,200	450,840.00	0.36
27	002666	德联集团	48,700	449,988.00	0.36
28	002404	嘉欣丝绸	57,000	449,730.00	0.36
29	002020	京新药业	36,300	449,031.00	0.36
30	002014	永新股份	28,100	448,195.00	0.36
31	002088	鲁阳节能	28,800	448,128.00	0.36
32	600854	春兰股份	59,800	446,706.00	0.36
33	601126	四方股份	42,400	446,472.00	0.36
34	002585	双星新材	42,000	446,040.00	0.36
35	600622	嘉宝集团	32,400	445,500.00	0.36

36	600566	济川药业	17,300	445,302.00	0.36
37	600218	全柴动力	43,400	443,548.00	0.36
38	002435	长江润发	24,500	440,755.00	0.35
39	000662	天夏智慧	20,500	440,750.00	0.35
40	000650	仁和药业	54,000	440,640.00	0.35
41	002566	益盛药业	33,800	440,414.00	0.35
42	600510	黑牡丹	50,400	439,488.00	0.35
43	002198	嘉应制药	42,500	439,450.00	0.35
44	603311	金海环境	19,100	438,345.00	0.35
45	600976	健民集团	16,300	437,655.00	0.35
46	600255	鑫科材料	100,800	437,472.00	0.35
47	002328	新朋股份	43,800	437,124.00	0.35
48	002365	永安药业	24,000	437,040.00	0.35
49	002540	亚太科技	50,100	436,872.00	0.35
50	000587	金洲慈航	28,300	436,669.00	0.35
51	002193	山东如意	26,600	436,506.00	0.35
52	601518	吉林高速	111,000	435,120.00	0.35
53	002026	山东威达	34,600	434,922.00	0.35
54	600723	首商股份	48,700	434,891.00	0.35
55	002062	宏润建设	73,460	434,883.20	0.35
56	600480	凌云股份	30,800	434,280.00	0.35
57	000043	中航地产	52,500	433,125.00	0.35
58	000544	中原环保	30,300	432,987.00	0.35
59	000889	茂业通信	39,900	432,915.00	0.35
60	002541	鸿路钢构	25,100	432,473.00	0.35
61	600337	美克家居	33,200	431,932.00	0.35
62	600982	宁波热电	82,100	431,846.00	0.35
63	002478	常宝股份	38,300	430,492.00	0.35
64	600211	西藏药业	9,700	430,292.00	0.35
65	002064	华峰氨纶	89,600	430,080.00	0.35

66	601339	百隆东方	67,600	429,260.00	0.34
67	600290	华仪电气	43,900	428,903.00	0.34
68	000591	太阳能	28,400	428,556.00	0.34
69	601890	亚星锚链	47,100	428,139.00	0.34
70	000419	通程控股	58,800	428,064.00	0.34
71	600969	郴电国际	28,700	427,917.00	0.34
72	002394	联发股份	28,300	427,330.00	0.34
73	600483	福能股份	37,600	426,760.00	0.34
74	600051	宁波联合	41,500	426,620.00	0.34
75	002160	常铝股份	48,700	426,612.00	0.34
76	600178	东安动力	48,900	426,408.00	0.34
77	000905	厦门港务	40,900	426,178.00	0.34
78	000989	九芝堂	18,690	425,571.30	0.34
79	601218	吉鑫科技	81,200	425,488.00	0.34
80	600985	雷鸣科化	38,600	425,372.00	0.34
81	002462	嘉事堂	11,400	424,650.00	0.34
82	002098	浔兴股份	36,475	423,839.50	0.34
83	600396	金山股份	80,800	423,392.00	0.34
84	600569	安阳钢铁	164,100	423,378.00	0.34
85	600513	联环药业	21,991	423,326.75	0.34
86	600761	安徽合力	41,900	422,771.00	0.34
87	000707	双环科技	59,200	422,688.00	0.34
88	000850	华茂股份	72,200	422,370.00	0.34
89	300108	双龙股份	48,500	421,950.00	0.34
90	002083	孚日股份	66,900	421,470.00	0.34
91	600327	大东方	47,200	421,024.00	0.34
92	600356	恒丰纸业	39,300	420,510.00	0.34
93	600299	安迪苏	30,500	420,290.00	0.34
94	002457	青龙管业	40,900	420,043.00	0.34
95	000597	东北制药	47,300	420,024.00	0.34

96	002302	西部建设	58,100	419,482.00	0.34
97	601678	滨化股份	82,400	419,416.00	0.34
98	600409	三友化工	62,200	419,228.00	0.34
99	300214	日科化学	54,400	418,880.00	0.34
100	000951	中国重汽	43,800	418,728.00	0.34
101	002641	永高股份	50,800	418,592.00	0.34
102	002520	日发精机	28,350	418,446.00	0.34
103	001896	豫能控股	48,500	418,070.00	0.34
104	000708	大冶特钢	37,300	417,760.00	0.34
105	600509	天富能源	56,800	417,480.00	0.34
106	600128	弘业股份	32,500	416,975.00	0.33
107	002487	大金重工	47,100	416,835.00	0.33
108	600833	第一医药	26,300	416,329.00	0.33
109	000822	山东海化	82,100	416,247.00	0.33
110	002300	太阳电缆	42,700	415,471.00	0.33
111	000789	万年青	67,200	415,296.00	0.33
112	000599	青岛双星	60,300	414,864.00	0.33
113	000756	新华制药	38,600	414,178.00	0.33
114	600814	杭州解百	39,100	414,069.00	0.33
115	600658	电子城	40,000	413,200.00	0.33
116	000422	湖北宜化	67,600	413,036.00	0.33
117	002342	巨力索具	71,200	412,960.00	0.33
118	002187	广百股份	33,500	412,720.00	0.33
119	600720	祁连山	61,500	412,665.00	0.33
120	600223	鲁商置业	80,900	412,590.00	0.33
121	600561	江西长运	33,700	411,814.00	0.33
122	600830	香溢融通	43,900	411,782.00	0.33
123	600508	上海能源	44,400	411,588.00	0.33
124	002538	司尔特	44,000	411,400.00	0.33
125	002258	利尔化学	43,800	411,282.00	0.33

126	000715	中兴商业	28,500	411,255.00	0.33
127	600064	南京高科	27,500	411,125.00	0.33
128	600348	阳泉煤业	64,400	410,228.00	0.33
129	600039	四川路桥	104,100	410,154.00	0.33
130	000030	富奥股份	57,200	410,124.00	0.33
131	000928	中钢国际	32,600	410,108.00	0.33
132	600239	云南城投	88,300	409,712.00	0.33
133	600889	南京化纤	38,000	409,640.00	0.33
134	000859	国风塑业	76,400	409,504.00	0.33
135	600963	岳阳林纸	66,900	409,428.00	0.33
136	002398	建研集团	31,100	408,654.00	0.33
137	601996	丰林集团	53,400	408,510.00	0.33
138	000949	新乡化纤	101,800	408,218.00	0.33
139	600159	大龙地产	87,400	408,158.00	0.33
140	000627	天茂集团	52,800	408,144.00	0.33
141	600791	京能置业	58,700	407,965.00	0.33
142	000902	新洋丰	32,600	407,826.00	0.33
143	600063	皖维高新	92,000	407,560.00	0.33
144	601188	龙江交通	100,600	407,430.00	0.33
145	000301	东方市场	94,000	407,020.00	0.33
146	601677	明泰铝业	30,500	406,870.00	0.33
147	000692	惠天热电	72,900	406,782.00	0.33
148	600272	开开实业	23,100	406,329.00	0.33
149	002516	旷达科技	67,300	405,819.00	0.33
150	600326	西藏天路	50,600	405,812.00	0.33
151	002616	长青集团	19,600	405,720.00	0.33
152	000429	粤高速 A	73,700	405,350.00	0.33
153	601616	广电电气	71,600	405,256.00	0.33
154	600708	光明地产	48,300	405,237.00	0.33
155	002563	森马服饰	37,400	405,042.00	0.33

156	600810	神马股份	54,200	404,874.00	0.33
157	000906	物产中拓	34,100	404,767.00	0.32
158	000607	华媒控股	48,000	404,640.00	0.32
159	600782	新钢股份	75,800	404,014.00	0.32
160	600815	厦工股份	63,400	403,858.00	0.32
161	000678	襄阳轴承	51,100	403,690.00	0.32
162	000739	普洛药业	65,000	403,650.00	0.32
163	002078	太阳纸业	82,600	403,088.00	0.32
164	600858	银座股份	49,200	402,948.00	0.32
165	000698	沈阳化工	61,600	402,864.00	0.32
166	600126	杭钢股份	67,100	402,600.00	0.32
167	600295	鄂尔多斯	51,000	402,390.00	0.32
168	600573	惠泉啤酒	30,300	402,384.00	0.32
169	600824	益民集团	67,300	401,781.00	0.32
170	600481	双良节能	70,100	401,673.00	0.32
171	000667	美好集团	112,500	401,625.00	0.32
172	600605	汇通能源	20,800	401,232.00	0.32
173	600261	阳光照明	56,800	401,008.00	0.32
174	600657	XD信达地	80,500	400,890.00	0.32
175	002143	印纪传媒	17,100	400,653.00	0.32
176	600249	两面针	57,400	400,652.00	0.32
177	000900	现代投资	59,400	400,356.00	0.32
178	000652	泰达股份	87,000	400,200.00	0.32
179	000830	鲁西化工	88,500	400,020.00	0.32
180	600567	山鹰纸业	140,800	399,872.00	0.32
181	000888	峨眉山A	33,200	399,728.00	0.32
182	600351	亚宝药业	39,800	399,194.00	0.32
183	002233	塔牌集团	49,700	399,091.00	0.32
184	600240	华业资本	39,800	398,796.00	0.32
185	600320	振华重工	93,800	398,650.00	0.32

186	600748	上实发展	41,300	398,132.00	0.32
187	600716	凤凰股份	53,500	398,040.00	0.32
188	600020	中原高速	89,900	397,358.00	0.32
189	601008	连云港	83,800	397,212.00	0.32
190	600461	洪城水业	30,600	397,188.00	0.32
191	000828	东莞控股	43,700	396,796.00	0.32
192	600269	赣粤高速	91,200	396,720.00	0.32
193	600190	锦州港	97,700	395,685.00	0.32
194	002122	天马股份	63,600	395,592.00	0.32
195	002333	罗普斯金	40,600	395,444.00	0.32
196	600350	山东高速	74,600	395,380.00	0.32
197	601992	金隅股份	51,000	395,250.00	0.32
198	600780	通宝能源	78,700	395,074.00	0.32
199	002060	粤水电	57,500	395,025.00	0.32
200	600033	福建高速	124,500	394,665.00	0.32
201	002693	双成药业	41,700	394,482.00	0.32
202	600697	欧亚集团	13,300	394,478.00	0.32
203	000027	深圳能源	61,800	394,284.00	0.32
204	000978	桂林旅游	37,500	394,125.00	0.32
205	600835	上海机电	20,500	393,395.00	0.32
206	600801	XD华新水	62,300	393,113.00	0.32
207	600787	中储股份	52,900	393,047.00	0.32
208	000683	远兴能源	150,000	393,000.00	0.32
209	600578	京能电力	91,800	392,904.00	0.32
210	600665	天地源	80,600	390,910.00	0.31
211	600812	华北制药	62,500	388,125.00	0.31
212	000539	粤电力A	77,100	387,042.00	0.31
213	000529	广弘控股	47,200	386,096.00	0.31
214	000605	渤海股份	21,190	385,022.30	0.31
215	600093	禾嘉股份	31,000	384,710.00	0.31

216	600973	宝胜股份	48,700	383,756.00	0.31
217	002419	天虹商场	32,000	382,720.00	0.31
218	000600	建投能源	43,800	382,374.00	0.31
219	600026	中海发展	64,700	381,730.00	0.31
220	000560	昆百大 A	42,500	381,650.00	0.31
221	600790	轻纺城	65,000	381,550.00	0.31
222	601179	中国西电	75,000	380,250.00	0.31
223	000557	西部创业	72,200	379,050.00	0.30
224	000898	鞍钢股份	98,700	378,021.00	0.30
225	600262	北方股份	14,100	378,021.00	0.30
226	002147	新光圆成	24,400	377,956.00	0.30
227	000863	三湘股份	40,900	376,280.00	0.30
228	600248	DR延长化	61,630	375,943.00	0.30
229	600322	天房发展	84,100	375,086.00	0.30
230	600826	兰生股份	14,300	374,374.00	0.30
231	600984	建设机械	43,100	372,815.00	0.30
232	600693	东百集团	55,300	371,616.00	0.30
233	600827	百联股份	30,700	370,856.00	0.30
234	600548	深高速	47,550	370,414.50	0.30
235	600137	浪莎股份	12,600	369,054.00	0.30
236	002687	乔治白	30,600	366,894.00	0.29
237	601566	九牧王	23,600	364,384.00	0.29
238	600426	华鲁恒升	41,330	364,117.30	0.29
239	002531	天顺风能	56,520	362,293.20	0.29
240	600558	大西洋	79,550	361,952.50	0.29
241	000719	大地传媒	34,240	361,574.40	0.29
242	600162	香江控股	86,250	361,387.50	0.29
243	000501	鄂武商 A	22,287	349,683.03	0.28
244	600860	京城股份	37,700	317,811.00	0.26
245	002621	三垒股份	14,200	312,400.00	0.25

246	600742	一汽富维	24,100	301,009.00	0.24
247	000916	华北高速	58,800	294,588.00	0.24
248	600121	郑州煤电	58,900	282,720.00	0.23
249	600105	DR永鼎股	29,600	277,352.00	0.22
250	000639	西王食品	19,400	273,928.00	0.22
251	000498	山东路桥	46,700	268,992.00	0.22
252	000407	胜利股份	38,700	260,451.00	0.21
253	600475	华光股份	15,800	234,630.00	0.19
254	002120	新海股份	11,000	225,280.00	0.18
255	002101	广东鸿图	9,300	201,066.00	0.16
256	000636	风华高科	20,700	182,988.00	0.15
257	000612	焦作万方	25,500	182,070.00	0.15
258	000537	广宇发展	21,500	172,215.00	0.14
259	300225	金力泰	24,100	171,592.00	0.14
260	002447	壹桥海参	22,500	161,775.00	0.13
261	600035	楚天高速	30,700	155,342.00	0.12
262	000608	阳光股份	29,300	155,290.00	0.12
263	600488	天药股份	25,700	151,887.00	0.12
264	000818	方大化工	21,000	137,970.00	0.11

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601339	百隆东方	850,650.45	0.68
2	002566	益盛药业	825,417.00	0.66
3	000422	湖北宜化	822,565.00	0.66
4	000708	大冶特钢	807,467.29	0.65
5	002233	塔牌集团	775,417.45	0.62

6	000419	通程控股	769,377.12	0.62
7	600261	阳光照明	768,842.00	0.62
8	000692	惠天热电	761,857.81	0.61
9	600162	香江控股	760,731.05	0.61
10	002495	佳隆股份	714,078.52	0.57
11	002078	太阳纸业	705,439.00	0.57
12	600969	郴电国际	699,120.00	0.56
13	600561	江西长运	697,327.00	0.56
14	600356	恒丰纸业	694,825.00	0.56
15	600239	云南城投	693,378.00	0.56
16	603311	金海环境	693,359.00	0.56
17	002419	天虹商场	692,346.00	0.56
18	600815	厦工股份	691,704.00	0.56
19	000949	新乡化纤	691,141.00	0.55
20	002187	广百股份	688,773.97	0.55

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002267	陕天然气	586,525.00	0.47
2	000418	小天鹅 A	554,600.00	0.45
3	601107	四川成渝	508,375.00	0.41
4	600114	东睦股份	507,653.00	0.41
5	600054	黄山旅游	501,217.00	0.40
6	600803	新奥股份	495,842.00	0.40
7	002054	德美化工	491,863.00	0.39
8	600829	人民同泰	482,566.77	0.39
9	600981	汇鸿集团	467,753.00	0.38

10	600859	王府井	462,908.00	0.37
11	000404	华意压缩	461,495.53	0.37
12	002406	远东传动	461,328.00	0.37
13	600823	世茂股份	457,308.16	0.37
14	002068	黑猫股份	456,126.20	0.37
15	300121	阳谷华泰	456,021.64	0.37
16	000965	天保基建	454,759.00	0.37
17	000550	江铃汽车	453,938.10	0.36
18	002637	赞宇科技	453,418.00	0.36
19	000823	超声电子	452,569.80	0.36
20	300138	晨光生物	452,110.20	0.36

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	228,624,070.75
卖出股票的收入（成交）总额	132,544,780.16

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	30,709.13
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,749.07
5	应收申购款	3,205,096.37
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,238,554.57

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	600203	福日电子	529,920.00	0.43	

§ 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

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
1,640	67,692.98	10,992,113.49	9.90%	100,024,367.28	90.10%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,289,488.35	1.16%

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年1月22日)基金份额总额	202,639,215.47
基金合同生效日基金份额总额	202,639,215.47
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	95,837,134.61

基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	187,459,869.31
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—
本报告期期末基金份额总额	111,016,480.77

§ 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未发生重大人事变动。

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，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，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 元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	

第一创业证券	2	121,038,725.98	33.51%	87,235.84	30.46%	—
国信证券	2	130,483,706.04	36.13%	120,084.81	41.93%	—
银河证券	2	109,646,418.89	30.36%	79,040.3	27.6%	—
东兴证券	2	—	—	—	—	—
中信建投证券	2	—	—	—	—	—
中银国际证券	2	—	—	—	—	—

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东兴证券2个交易单元、中银国际证券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	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
第一创业证券	—	—	1,149,000,000	67.99%	—	—
国信证券	—	—	205,000,000	12.13%	—	—
银河证券	—	—	336,000,	19.88%	—	—

			000			
东兴证券	—	—	—	—	—	—
中信建投证 券	—	—	—	—	—	—
中银国际证 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发售公告	公司官网、证券时报	2015-12-20
2	创金合信量化多因子股票型证券投资基金2016年第1季度报告	公司官网、证券时报	2016-04-22
3	创金合信量化多因子股票型证券投资基金2016年第2季度报告	公司官网、证券时报	2016-07-20
4	创金合信基金管理有限公司关于延长创金合信量化多因子股票型证券投资基金募集期的公告	公司官网、证券时报	2016-01-19
5	创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、证券时报	2016-01-23
6	创金合信量化多因子股票型证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务公告	公司官网、证券时报	2016-01-23
7	创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、证券时报	2016-01-26
8	创金合信基金关于调整创金合信量化多因子股票型证券投资基金申购金额下限的公告	公司官网、证券时报	2016-08-12
9	创金合信基金管理有限公司关于创金合信量化多因子股票型证券投资基金提前结束募集的公告	公司官网、证券时报	2016-01-20

§ 11 备查文件目录

11.1 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2016年半年度报告原文

11.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

11.3 查阅方式

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

创金合信基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日