

创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金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27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01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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12
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等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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	41
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44

10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4	基金投资策略的改变 .....	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8	其他重大事件 .....	46
§11	备查文件目录 .....	48
11.1	备查文件目录 .....	48
11.2	存放地点 .....	48
11.3	查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	创金沪港深精选混合
基金主代码	001662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月24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	223,989,642.28份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金积极进行资产配置，深入挖掘受益于国家经济增长和转型过程中涌现出来的持续成长性良好的和业绩稳定增长的优秀企业进行积极投资，充分分享中国经济增长和优化资产配置的成果，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金以"底线思维"为原则，将组合最大回撤风险控制在能够承受的范围之内；抛弃乐观幻想，明确区分主观期望与市场现实。其次要严格考察风险收益比，承担仓位风险要有回报。操作策略方面重点关注四种类型：其一是深V型超跌反弹的机会；其二是主题轮动行情中的分散潜伏/收割兑现策略；其三是密切关注大小市值风格轮动机会，捕捉短暂的大市值风格补涨机会；第四是中小市值个股的个性化超额收益策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，属于证券投资基金中

	的中等风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。
--	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	创金合信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋
	联系电话	0755-23838908
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	95588
传真	0755-25832571	010-66105798
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	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-25,344,408.98
本期利润	-25,049,068.50
加权平均基金份额本期利润	-0.1074
本期加权平均净值利润率	-12.37%
本期基金份额净值增长率	-9.95%
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	1,607,338.17
期末可供分配基金份额利润	0.0072
期末基金资产净值	200,690,157.50
期末基金份额净值	0.896
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	-10.40%

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。

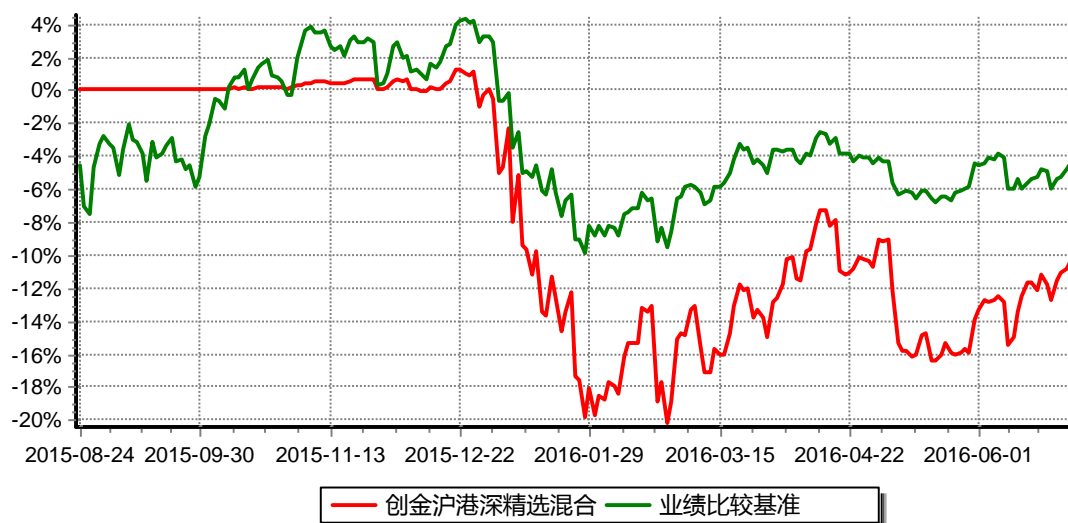
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	①-③	②-④

				④		
过去一个月	4.07%	1.04%	0.00%	0.63%	4.07%	0.41%
过去三个月	2.52%	1.21%	-0.94%	0.55%	3.46%	0.66%
过去六个月	-9.95%	1.85%	-7.14%	0.92%	-2.81%	0.93%
自基金合同生效日起 至今（2015年08月24 日-2016年06月30日）	-10.40%	1.42%	-4.45%	1.01%	-5.95%	0.41%

### 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		
张荣	基金经理	2015年8月24日	—	6	张荣先生，中国国籍，北京大学金融学硕士。2004年就职于深圳银监局从事银行监管工作，历任多家银行监管员。2010年加入第一创业证券资产管理部，历任金融行业研究主管、投资主办等职务。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司担任高级研究员，现任基金经理。
李晗	基金经理	2015年8月24日	—	8	李晗先生，中国国籍，中南财经政法大学硕士，金融风险管理师（FRM），权益投资基金经理。投资中注重基本面研究，寻找行业和企业发展的拐点，擅长挖掘估值合理的持续成长股，与优质企业共同成长中获取丰厚回报。曾任职于海航集团从事并购整合业务。此后任职于鹏华基金，从事专户业务、企业年金业务的研究工作。2009年11月加盟第一创业证券资产管理部，曾担任多个集合理财产品投

					资主办，投资经验丰富。
陈玉辉	基金经理、投资一部总监	2015年8月24日	—	13	陈玉辉先生，中国国籍，经济学硕士，2003年6月加入新疆证券有限责任公司，从事石化行业研究；2005年度获中央电视台、中国证券报联合评选的首届"全国十佳证券分析师"。2006年1月加入东方证券股份有限公司研究所，任化工行业研究员。2008年3月加入招商基金管理有限公司，历任研究部副总监、总监，并于2012年11月14日至2015年4月10日担任招商大盘蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2015年7月任创金合信基金管理有限公司投资一部总监。

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、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合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

沪港深研究精选基金成立于2015年8月24日，在成立初期暂时采取类CPPI动态保本策略进行操作，2016年一季度开始转向参照业绩基准的相对收益操作。上半年基金重点配置了锂电池相关化工、新材料、有色等周期类行业和低估值银行股。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年中期期末基金净值为0.896元，上半年涨幅-9.95%。上半年HS300跌幅15.5%，香港恒生指数跌幅5.1%，业绩基准跌幅7.14%，基金涨幅落后业绩基准2.81%。基金净值落后于业绩基准的原因主要是由于组合仓位高于业绩基准。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然经历了2015年三季度以来持续四个季度的调整，但A股市场除金融等大盘蓝筹股票估值较低外，中小市值和创业板股票整体市盈率、市净率估值仍然处于绝对高位。预计2016年下半年A股市场将继续对之前三年累计历史涨幅进行修正，中小市值股票继续振荡回吐相对于大中市值股票的巨大超额收益和相对高估值。宏观经济不确定因素可能在2016年后期冲击A股走势，市场流动性仍在逐步减弱，而参与资金绝对收益止损操作策略趋同，导致之前急跌缓涨的市场特征可能延续。

未来操作原则上将继续坚持“底线思维”，将组合最大回撤风险控制在可承受范围之内，严格考察个股风险收益比，努力提高组合信息比。仓位调整将适应市场变化，未来更积极地以类绝对收益方式进行仓位灵活调整。风格配置方面，延续低市盈率、低市净率、低市场预期的行业和个股选择策略；主题方面，倾向于供给侧改革和国企改革两条主线，适当关注新兴产业相关的各类主题性机会。

操作策略方面重点关注四种类型：第一是深V型超跌反弹的机会；其二是主题轮动行情中的分散潜伏/收割兑现策略；其三是密切关注大小市值风格轮动机会，以相对均衡

的大、中、小市值三分法均衡配置，捕捉大市值风格补涨机会；第四是中小市值个股的主题性和个性化超额收益策略。

#### 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

结合法律法规的规定及《基金合同》的约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

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沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金的管理人--创

金合信基金管理有限公司在创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金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：创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度末 2015年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	16,139,622.37	15,901,846.23
结算备付金		507,663.32	21,826,917.00
存出保证金		232,883.09	13,128.52
交易性金融资产	6.4.7.2	155,131,975.59	166,111,695.90
其中：股票投资		155,131,975.59	166,111,695.90
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	—	44,000,000.00
应收证券清算款		30,137,047.67	—

应收利息	6.4.7.5	9,174.39	14,642.51
应收股利		49,184.00	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		202,207,550.43	247,868,230.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		251,397.81	213,294.52
应付赎回款		664,058.66	—
应付管理人报酬		243,070.69	325,320.18
应付托管费		40,511.76	54,220.07
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	236,478.64	221,976.23
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	81,875.37	83,000.00
负债合计		1,517,392.93	897,811.00
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	223,989,642.28	248,272,977.05
未分配利润	6.4.7.10	-23,299,484.78	-1,302,557.89
所有者权益合计		200,690,157.50	246,970,419.16
负债和所有者权益总计		202,207,550.43	247,868,230.16

注：1.报告截止日2016年6月30日，基金份额净值0.896元，基金份额总额223,989,642.28份；  
2.本基金合同生效日为2015年8月24日，无上年度可比区间。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1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1日至2016年6月30日
一、收入		-22,216,240.04
1.利息收入		159,066.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	136,085.29
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		22,981.25
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		-22,708,233.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-23,283,118.82
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	574,885.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	295,340.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号	6.4.7.17	37,586.76

填列		
<b>减：二、费用</b>		2,832,828.46
1. 管理人报酬		1,512,165.92
2. 托管费		252,027.67
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	981,947.57
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	86,687.30
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-25,049,068.50
减：所得税费用		—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-25,049,068.50

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1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)	248,272,977.05	-1,302,557.89	246,970,419.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-25,049,068.50	-25,049,068.50
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)	-24,283,334.77	3,052,141.61	-21,231,193.16
其中：1.基金申购款	357,069.02	-46,038.54	311,030.48
2.基金赎回款	-24,640,403.79	3,098,180.15	-21,542,223.64



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）	223,989,642.28	-23,299,484.78	200,690,157.50

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

创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]第1477号《关于准予创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币303,724,280.18元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第987号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年8月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为303,868,723.06份基金份额，其中认购资金利息折合144,442.88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《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称"港股通标的股票")、权证、股指期货、债券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款以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：沪深300 指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%+中债总指数(全价)收益率×40%。

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26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》、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年1月1日至2016年6月30日止期间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1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 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 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	16,139,622.37
定期存款	—
其中: 存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	16,139,622.37

### 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		156,276,668.66	155,131,975.59	-1,144,693.07
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	156,276,668.66	155,131,975.59	-1,144,693.07

### 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	8,841.29
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	228.40
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	104.70
合计	9,174.39

### 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	236,478.64
银行间市场应付交易费用	—
合计	236,478.64

#### 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	2,314.07
预提费用	79,561.30
合计	81,875.37

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	248,272,977.05	248,272,977.05
本期申购	357,069.02	357,069.02
本期赎回（以“-”号填列）	-24,640,403.79	-24,640,403.79
本期末	223,989,642.28	223,989,642.28

注：申购含红利再投、转换入份(金)额；赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

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	249,345.90	-1,551,903.79	-1,302,557.89
本期利润	-25,344,408.98	295,340.48	-25,049,068.50
本期基金份额交易产生的变动数	1,357,992.27	1,694,149.34	3,052,141.61

其中：基金申购款	-22,364.01	-23,674.53	-46,038.54
基金赎回款	1,380,356.28	1,717,823.87	3,098,180.15
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-23,737,070.81	437,586.03	-23,299,484.78

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	112,848.45
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	21,952.85
其他	1,283.99
合计	136,085.29

#### 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1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-23,283,118.82
股票投资收益——赎回差价 收入	—
合计	-23,283,118.82

##### 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1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	334,832,795.14
减：卖出股票成本总额	358,115,913.96
买卖股票差价收入	-23,283,118.82

### 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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本期未发生衍生工具收益。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	574,885.00
基金投资产生的股利收益	—
合计	574,885.00

### 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1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	295,340.48
——股票投资	295,340.48
——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	295,340.48
----	------------

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	37,586.76
合计	37,586.76

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，对于持有期少于30日(不含)的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于30日(含)但少90日(不含)的基金份额所收取的赎回费，赎回费用75%归入基金财产；对于持有期长于90日(含)但小于180日(不含)的基金份额所收取的赎回费，赎回费用50%归入基金财产；对于持有期长于180日(含)的基金份额所收取的赎回费，赎回费用25%归入基金财产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	981,947.57
银行间市场交易费用	—
合计	981,947.57

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	36,835.26
信息披露费	49,726.04
汇划手续费	126.00
合计	86,687.30

#### 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，本基金无需作披露的或有事项。

#### 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，本基金无需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
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)	基金管理人的股东
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

#### 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

本基金于本期末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 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,512,165.92
其中：支付销售机构的客户维护费	951,873.44

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 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	252,027.67

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 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

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金合同生效日（2015年8月24日）持有的基金份额	10,010,250.00
期初持有的基金份额	10,010,250.00
期间申购/买入总份额	—
期间因拆分变动份额	—
减：期间赎回/卖出总份额	—

期末持有的基金份额	10,010,250.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.47%

**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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
第一创业证券 股份有限公司		—	4,999,450.00	2.01%

**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1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	16,139,622.37	112,848.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按金融机构同业存款利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金于本期末未进行利润分配。

**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

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	期末成本总额	期末估值总额
601966	玲珑轮胎	2016-06-28	2016-07-06	新发流通受限	12.98	12.98	1,534	19,911.32	19,911.32
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-04	新发流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98
300520	科大国创	2016-06-28	2016-07-08	新发流通受限	10.05	10.05	926	9,306.3	9,306.3
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新发流通受限	5.8	5.8	971	5,631.8	5,631.8

### 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
600796	钱江生化	2016-05-31	重大资产重组	9.80		—	378,800	3,717,698.93	3,712,240.00
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大资产重组	4.90		—	200,957	1,089,416.92	984,689.30
601611	中国核建	2016-06-30	临时停牌	20.92	2016-07-01	23.01	5,042	17,495.74	105,478.64

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公司的发行的证券

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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,139,622.37	—	—	—	16,139,622.37
结算备付金	507,663.32	—	—	—	507,663.32
存出保证金	232,883.09	—	—	—	232,883.09
交易性金融资产	—	—	—	155,131,975.59	155,131,975.59
应收证券清算款	—	—	—	30,137,047.67	30,137,047.67
应收利息	—	—	—	9,174.39	9,174.39
应收股利	—	—	—	49,184.00	49,184.00

资产总计	16,880,168.78	—	—	185,327,381.65	202,207,550.43
负债					
应付证券清算款	—	—	—	251,397.81	251,397.81
应付赎回款	—	—	—	664,058.66	664,058.66
应付管理人报酬	—	—	—	243,070.69	243,070.69
应付托管费	—	—	—	40,511.76	40,511.76
应付交易费用	—	—	—	236,478.64	236,478.64
其他负债	—	—	—	81,875.37	81,875.37
负债总计	—	—	—	1,517,392.93	1,517,392.93
利率敏感度缺口	16,880,168.78	—	—	183,809,988.72	200,690,157.50
上年度末 2015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	15,901,846.23	—	—	—	15,901,846.23
结算备付金	21,826,917.00	—	—	—	21,826,917.00
存出保证金	13,128.52	—	—	—	13,128.52
交易性金融资产	—	—	—	166,111,695.90	166,111,695.90
买入返售金融资产	44,000,000.00	—	—	—	44,000,000.00
应收利息	—	—	—	14,642.51	14,642.51
资产总计	81,741,891.75	—	—	166,126,338.41	247,868,230.16
负债					

应付证券清算款	—	—	—	213,294.52	213,294.52
应付管理人报酬	—	—	—	325,320.18	325,320.18
应付托管费	—	—	—	54,220.07	54,220.07
应付交易费用	—	—	—	221,976.23	221,976.23
其他负债	—	—	—	83,000.00	83,000.00
负债总计	—	—	—	897,811.00	897,811.00
利率敏感度缺口	81,741,891.75	—	—	165,228,527.41	246,970,419.16

#### 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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的0-95%，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，债券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具的投资比例为基金资产的5%-100%。其中，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，



应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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		上年度末 2015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	155,131,975.59	77.30	166,111,695.90	67.26
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	155,131,975.59	77.30	166,111,695.90	67.26

#### 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150,435,046.29元，属于第二层次的余额为 4,696,929.30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	155,131,975.59	76.72
	其中：股票	155,131,975.59	76.72
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	16,647,285.69	8.23
7	其他各项资产	30,428,289.15	15.05
8	合计	202,207,550.43	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为2,110,341.12元，占净值比为1.05%。

## 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	2,265,650.00	1.13
B	采矿业	5,841,917.60	2.91
C	制造业	87,937,092.39	43.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,801,626.15	5.38
E	建筑业	105,478.64	0.05
F	批发和零售业	5,881,899.35	2.93
G	交通运输、仓储和邮政业	3,516,296.00	1.75
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,177.25	0.02
J	金融业	23,957,734.99	11.94
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	—	—
S	综合	12,647,636.00	6.30
	合计	153,021,634.47	76.25

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A 农、林、牧、渔业	0	0
B 采矿业	713407.96	36
C 制造业	238031.64	12
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	0	0
E 建筑业	0	0
F 批发和零售业	0	0
G 交通运输、仓储和邮政业	252801.28	11
H 住宿和餐饮业	0	0
I 信息传输、软件和信息技术服务业	0	0
J 金融业	906100.24	45
K 房地产业	0	0
L 租赁和商务服务业	0	0
M 科学研究和技术服务业	0	0
N 水利、环境和公共设施管理业	0	0
O 居民服务、修理和其他服务业	0	0
P 教育	0	0
Q 卫生和社会工作	0	0
R 文化、体育和娱乐业	0	0
S 综合	0	0
合计	2110341.12	1.05

注：通过沪港深机制投资的股票所属行业分类采用中国证券监督管理委员会制定的《上市公司行业分类指引》。

### 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	600888	新疆众和	2,656,044	18,911,033.28	9.42
2	600731	湖南海利	1,372,215	13,790,760.75	6.87
3	600784	鲁银投资	1,435,600	12,647,636.00	6.30
4	600509	天富能源	1,469,609	10,801,626.15	5.38
5	000001	平安银行	1,186,630	10,323,681.00	5.14
6	600328	兰太实业	628,257	7,551,649.14	3.76
7	600883	XD博闻科	422,871	6,135,858.21	3.06
8	601818	光大银行	1,300,000	4,888,000.00	2.44
9	600015	华夏银行	488,766	4,833,895.74	2.41
10	000876	新希望	510,000	4,243,200.00	2.11
11	600192	长城电工	390,554	4,186,738.88	2.09
12	600746	江苏索普	419,886	4,127,479.38	2.06
13	601998	中信银行	689,975	3,912,158.25	1.95
14	000709	河钢股份	1,400,000	3,878,000.00	1.93
15	000731	四川美丰	518,800	3,750,924.00	1.87
16	600796	钱江生化	378,800	3,712,240.00	1.85
17	000422	湖北宜化	547,962	3,348,047.82	1.67
18	600028	中国石化	689,943	3,256,530.96	1.62
19	000635	英力特	249,946	3,009,349.84	1.50
20	600586	金晶科技	652,400	2,805,320.00	1.40
21	600125	铁龙物流	430,657	2,743,285.09	1.37
22	600367	红星发展	195,494	2,715,411.66	1.35
23	600778	友好集团	278,921	2,705,533.70	1.35
24	000877	天山股份	388,836	2,403,006.48	1.20
25	600859	王府井	149,348	2,276,063.52	1.13
26	000528	柳工	280,000	1,814,400.00	0.90
27	600097	开创国际	115,000	1,760,650.00	0.88

28	601666	平煤股份	404,000	1,652,360.00	0.82
29	600019	宝钢股份	200,957	984,689.30	0.49
30	600123	兰花科创	129,948	933,026.64	0.46
31	600858	银座股份	109,927	900,302.13	0.45
32	601333	广深铁路	197,701	773,010.91	0.39
33	600108	亚盛集团	100,000	505,000.00	0.25
34	H03328	交通银行	100,000	419,904.30	0.21
35	H01088	中国神华	30,000	367,351.86	0.18
36	H01898	中煤能源	100,000	346,056.10	0.17
37	H00525	广深铁路股份	80,000	252,801.28	0.13
38	H06818	中国光大银行	80,000	243,183.84	0.12
39	H01288	农业银行	100,000	243,012.10	0.12
40	H02009	金隅股份	120,000	238,031.64	0.12
41	603737	三棵树	1,017	118,053.36	0.06
42	300516	久之洋	654	114,561.18	0.06
43	601611	中国核建	5,042	105,478.64	0.05
44	603131	N沪工	1,263	76,664.10	0.04
45	601127	小康股份	2,692	64,258.04	0.03
46	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.03
47	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
48	300518	盛讯达	787	36,870.95	0.02
49	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
50	603958	哈森申购	1,455	21,097.50	0.01
51	603909	合诚申购	1,095	20,126.10	0.01
52	601966	玲珑申购	1,534	19,911.32	0.01
53	603016	宏泰申购	1,602	13,600.98	0.01
54	300520	科大国创	926	9,306.30	—
55	002805	丰元股份	971	5,631.80	—

## 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	600888	新疆众和	20,087,707.27	8.13
2	600731	湖南海利	19,101,763.08	7.73
3	600328	兰太实业	17,696,484.18	7.17
4	600028	中国石化	13,808,681.77	5.59
5	600784	鲁银投资	12,823,070.00	5.19
6	000876	新希望	12,196,898.90	4.94
7	600509	天富能源	12,044,648.94	4.88
8	000877	天山股份	11,385,987.23	4.61
9	600019	宝钢股份	10,748,636.40	4.35
10	600586	金晶科技	9,589,579.00	3.88
11	000001	平安银行	9,589,546.50	3.88
12	600015	华夏银行	9,223,691.62	3.73
13	600123	兰花科创	8,779,816.74	3.56
14	601088	中国神华	8,261,583.00	3.35
15	000709	河钢股份	8,018,798.50	3.25
16	600068	葛洲坝	7,857,867.00	3.18
17	600883	XD博闻科	7,855,470.05	3.18
18	600367	红星发展	7,721,290.85	3.13
19	600005	武钢股份	7,632,884.00	3.09
20	600192	长城电工	7,604,055.33	3.08
21	000528	柳工	7,367,013.00	2.98
22	601666	平煤股份	7,043,239.10	2.85
23	600108	亚盛集团	6,534,754.01	2.65
24	601998	中信银行	6,507,817.75	2.64
25	600796	钱江生化	6,371,574.99	2.58

26	600096	云天化	6,226,626.04	2.52
27	000731	四川美丰	6,152,766.15	2.49
28	000422	湖北宜化	6,121,469.95	2.48
29	600778	友好集团	6,049,855.10	2.45
30	600125	铁龙物流	5,678,545.15	2.30
31	600859	王府井	5,623,537.53	2.28
32	600348	阳泉煤业	5,608,984.08	2.27
33	600126	杭钢股份	5,433,449.00	2.20

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	600028	中国石化	15,345,800.00	6.21
2	600328	兰太实业	12,802,314.92	5.18
3	000877	天山股份	11,992,470.72	4.86
4	600367	红星发展	11,837,000.00	4.79
5	600019	宝钢股份	11,561,424.95	4.68
6	601088	中国神华	10,702,529.95	4.33
7	600068	葛洲坝	9,735,512.59	3.94
8	000001	平安银行	9,490,514.02	3.84
9	600348	阳泉煤业	8,810,987.86	3.57
10	600015	华夏银行	8,621,087.38	3.49
11	601998	中信银行	8,543,311.99	3.46
12	600005	武钢股份	8,356,078.00	3.38
13	600731	湖南海利	8,345,840.16	3.38
14	600108	亚盛集团	8,149,038.81	3.30
15	000876	新希望	8,136,295.84	3.29
16	600016	民生银行	8,027,902.00	3.25
17	600888	新疆众和	7,702,734.64	3.12



18	600123	兰花科创	7,450,703.35	3.02
19	000709	河钢股份	7,382,773.02	2.99
20	601328	交通银行	7,338,400.00	2.97
21	600801	XD华新水	6,859,316.21	2.78
22	000422	湖北宜化	6,609,462.36	2.68
23	601939	建设银行	6,597,526.42	2.67
24	600096	云天化	6,294,362.85	2.55
25	000983	西山煤电	6,167,361.18	2.50
26	601288	农业银行	6,122,000.00	2.48
27	000731	四川美丰	5,869,509.77	2.38
28	600509	天富能源	5,841,710.85	2.37
29	600586	金晶科技	5,785,916.00	2.34
30	600126	杭钢股份	5,485,972.55	2.22
31	000528	柳 工	5,187,167.16	2.10
32	600778	友好集团	5,166,487.24	2.09
33	601333	广深铁路	5,138,518.56	2.08

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	346,840,853.17
卖出股票的收入（成交）总额	334,832,795.14

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	232,883.09
2	应收证券清算款	30,137,047.67
3	应收股利	49,184.00
4	应收利息	9,174.39
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	30,428,289.15

#### 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

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
1,667	134,366.91	10,010,250.00	4.47%	213,979,392.28	95.53%

#### 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	2,287,967.14	1.02%

#### 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	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	>100
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(2015年8月24日)基金份额总额	303,868,723.06
本报告期期初基金份额总额	248,272,977.05
本报告期基金总申购份额	357,069.02

减：本报告期基金总赎回份额	24,640,403.79
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	223,989,642.28

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内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	
东兴证券	2	377,323,	55.41%	350,117.9	59.77%	—

		753.34				
国信证券	2	79,299,799.61	11.65%	73,436.31	12.54%	—
银河证券	2	223,469,592	32.82%	162,212.23	27.69%	—
第一创业证券	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
东兴证券	—	—	87,000,000	74.36%	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	30,000,000	25.64%	—	—

第一创业证 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	创金合信沪港深研究精选证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、中国证券报	2015-07-22
2	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2016年第一季度报告	公司官网、中国证券报	2016-04-22
3	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2016年第二季度报告	公司官网、中国证券报	2016-07-20
4	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金合同生效公告	公司官网、中国证券报	2015-08-25
5	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司官网、中国证券报	2015-09-16
6	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金延长募集期的公告	公司官网、中国证券报	2015-09-16
7	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回公告	公司官网、中国证券报	2015-10-12
8	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金开放定期定额投资业务公告	公司官网、中国证券报	2015-10-15

9	关于指数熔断机制实施后对创金合信基金管理有限公司旗下公募基金业务规则影响的公告	公司官网、中国证券报	2015-12-31
10	创金合信基金管理有限公司旗下公募基金受指数熔断影响开放时间调整的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-04
11	创金合信基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-07
12	创金合信基金关于调整旗下部分开放式基金申购金额下限及最低持有金额下限的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-08
13	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2015年第四季度报告1.15	公司官网、中国证券报	2016-01-20
14	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告	公司官网、中国证券报	2016-03-26
15	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2015年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2016-03-26
16	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2016年第1号）	公司官网、中国证券报	2016-04-07
17	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016年第1号）	公司官网、中国证券报	2016-04-07
18	创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书主要更新内容说明	公司官网、中国证券报	2016-04-07
19	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金估值方法变更的提示性公告	公司官网、中国证券报	2016-07-08

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、创金合信沪港深研究精选灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告

### 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

二〇一六年八月二十七日