

# 创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金

## 2017 年半年度报告

2017 年 06 月 30 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2017 年 08 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2017 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 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	7
2.5 其他相关资料	7
§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	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
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	14
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
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	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49

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.....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信优价成长股票	
基金主代码	003622	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月02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	161,355,703.91份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信优价成长股票A	创金合信优价成长股票C
下属分级基金的交易代码	003622	003623
报告期末下属分级基金的份额总额	157,269,618.48份	4,086,085.43份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金秉承“理性分析价值，深度挖掘成长”的投资理念，以GARP (Growth at a Reasonable Price) 策略为核心，致力于寻找市场上具备成长潜力的上市公司，在其估值合理或被低估的时候，以更具估值优势的价格买入并相对长期持有，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。</p>
投资策略	<p>本基金的投资策略以GARP (Growth at a Reasonable Price) 策略为核心，是一种价值与成长并重的混合型投资策略。该策略的目标是：通过对行业和公司的深入基本面研究，寻找具备成长潜力的上市公司，在其估值合理或被低估的时候，以更具估值优势的价格买入并相对长期持有。GARP 策略融合了价值策略和成长策略的优势，以成长为</p>

	目标,分享了具备核心竞争力的优质企业成长所带来的丰厚收益;以具备相对估值优势的价格为标尺,筛选低估值股票,有效控制市场波动时的风险。在股票市场价值风格与成长风格发生轮动时,GAR P策略可兼顾价值与成长两种特征,能有效平滑收益波动,提高股票组合风险调整后收益。	
业绩比较基准	中证800指数收益率×90%+一年期人民币定期存款利率(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。	
下属分级基金的风险收益特征	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。	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5号
办公地址	深圳市福田区福华一路15号投行大厦15层	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码	518000	100140
法定代表人	刘学民	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年01月01日-2017年06月30日)	
	创金合信优价成长股票 A	创金合信优价成长股票 C
本期已实现收益	8,709,428.32	224,812.20
本期利润	7,209,088.79	306,743.90
加权平均基金份额本期利润	0.0621	0.0825
本期加权平均净值利润率	6.03%	8.10%
本期基金份额净值增长率	9.09%	8.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年06月30日)	
期末可供分配利润	9,494,062.57	236,820.03
期末可供分配基金份额利润	0.0604	0.0580
期末基金资产净值	167,737,728.05	4,348,164.30
期末基金份额净值	1.0666	1.0641

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.66%	6.41%

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

#### 创金合信优价成长股票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	6.28%	0.70%	4.59%	0.57%	1.69%	0.13%
过去三个月	2.28%	0.72%	2.82%	0.59%	-0.54%	0.13%
过去六个月	9.09%	0.71%	6.33%	0.54%	2.76%	0.17%
自基金合同生效起至今	6.66%	0.75%	4.30%	0.57%	2.36%	0.18%

#### 创金合信优价成长股票C

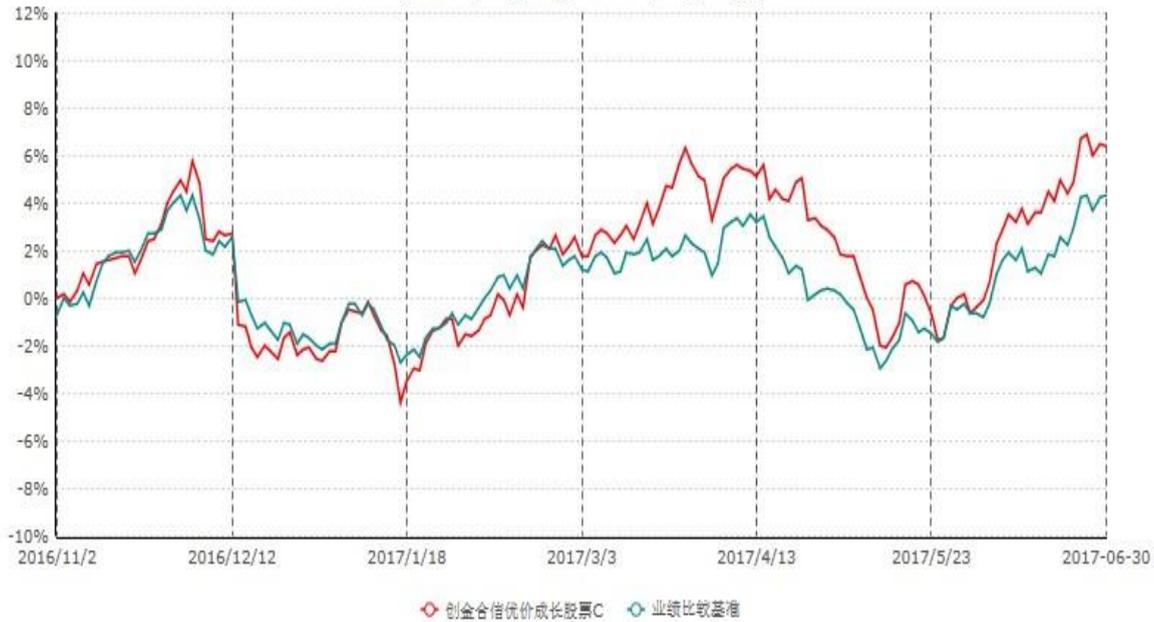
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.24%	0.69%	4.59%	0.57%	1.65%	0.12%
过去三个月	2.19%	0.72%	2.82%	0.59%	-0.63%	0.13%
过去六个月	8.88%	0.71%	6.33%	0.54%	2.55%	0.17%

自基金合同生效起至今	6.41%	0.75%	4.30%	0.57%	2.11%	0.18%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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



创金合信优价成长股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年11月02日-2017年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月2日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册成立，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4只公募基金。截至2017年6月30日，本公司共管理27只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品3只、债券型产品10只、股票型产品3只、货币型产品1只、保本型产品1只；管理的公募基金规模约153.51亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晗	基金经理	2016-11-02	-	10年	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。2014年8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、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

过去一段时间市场出现了显著的结构分化，部分公司出现了大幅度上涨，超额收益十分显著，但不排除其中部分标的未来一段时间进入休整期的可能。从中长期看，优质企业经过多年成长，已经初步完成了物质基础和管理能力的积累，随着外部制约因素的减弱和消除，部分优质企业将进入良性循环的发展轨道，因此前期市场的结构性分化只是一次对于价值投资的启蒙，随着优质企业不断崭露头角，市场会更加深入的理解和挖掘真正代表未来经济发展方向的优质投资标的。

在过去的一个季度中，我们所投资的部分优质蓝筹公司给组合带来了部分回报，随着市场情绪的逐步高涨，我们对部分超额收益显著的标的进行了调整，增加了部分具备潜力优质公司的持仓，试图以此降低产品波动性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值增长率为9.09%，C类净值增长率为8.88%，同期业绩比较基准收益率为6.33%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济基本面看，未来一段时间依然是改革攻坚、结构调整和政策托底共同作用下的弱平衡，大多数的行业仍处于“提质增效”和“三去一降一补”的过程中，趋势性复苏仍需时日。同时，我们也应注意到，劳动密集型行业过去多年持续的收入提升为潜在消费需求的释放奠定了基础，随着消费在整体经济中占比越来越高，经济的韧性也在增强。

从资本市场看，结构分化依然可能是未来较长一段时间的主旋律：经过2013-2015年的大幅上涨后很多个股仍然估值过高，部分公司成长和业绩的可持续性存在较大不确定性，后期调整的压力依然较大；部分具备核心竞争力的优质企业估值偏低，未来有望极大受益于其市场份额的提升；部分受益于消费升级的行业其可持续性也较强，有望迎来趋势性的投资机会；随着国企改革逐步走上正轨，优质国企的潜力有望得到激发和释

放，其价值也将逐步得到认同。

未来我们将继续重点关注高景气度的行业性投资机会，国企改革等带来的制度性机会，竞争中胜出的优质龙头企业所带来的个股性投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行

为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

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

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,020,541.67	498,198.45
结算备付金		76,815.20	164,372.85
存出保证金		43,455.41	2,440.36
交易性金融资产	6.4.7.2	162,982,881.83	11,910,962.12
其中：股票投资		162,982,881.83	11,910,962.12
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		2,217,665.20	-
应收利息	6.4.7.5	1,838.09	192.71
应收股利		-	-
应收申购款		19,767.77	500.00
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		174,362,965.17	12,576,666.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年06月30日</b>	<b>上年度末 2016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		1,838,109.12	-
应付赎回款		54,582.97	927.66
应付管理人报酬		205,699.43	16,097.84
应付托管费		34,283.24	2,682.95
应付销售服务费		1,711.55	1,441.89
应付交易费用	6.4.7.7	75,741.65	8,773.86
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	66,944.86	-
负债合计		2,277,072.82	29,924.20
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	161,355,703.91	12,834,217.79
未分配利润	6.4.7.1 0	10,730,188.44	-287,475.50
所有者权益合计		172,085,892.35	12,546,742.29
负债和所有者权益总计		174,362,965.17	12,576,666.49

注:1. 报告截止日2017年6月30日, 基金份额总额161,355,703.91份, 其中下属A类基金份额157,269,618.48份, C类基金份额4,086,085.43份。下属A类基金份额净值1.0666元, C类基金份额净值1.0641元。

2. 本基金合同生效日为2016年11月02日, 无上年度可比期间。

## 6.2 利润表

会计主体：创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年01月01日至2017年06月30日
<b>一、收入</b>		8,909,689.56
1. 利息收入		50,309.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	28,713.28
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		21,595.96
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,274,256.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,958,667.27
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		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,315,589.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,418,407.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,531.42
<b>减：二、费用</b>		1,393,856.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	892,714.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	148,785.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,335.00
4. 交易费用	6.4.7.19	276,002.43

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	67,019.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,515,832.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,515,832.69

注：本基金合同生效日为2016年11月02日，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	12,834,217.79	-287,475.50	12,546,742.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,515,832.69	7,515,832.69
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)	148,521,486.12	3,501,831.25	152,023,317.37
其中：1. 基金申购款	149,858,083.92	3,535,133.25	153,393,217.17
2. 基金赎回款	-1,336,597.80	-33,302.00	-1,369,899.80
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)	161,355,703.91	10,730,188.44	172,085,892.35

注：本基金合同生效日为2016年11月02日，无上年度可比期间。

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

创金合信优价成长股票型发起式基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2275号《关于准予创金合信优价成长股票型发起式基金注册的批复》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《创金合信优价成长股票型发起式基金基金合同》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10,186,822.11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1362号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信优价成长股票型发起式基金基金合同》于2016年11月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,187,722.65份基金份额,其中认购资金利息折合900.54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《创金合信优价成长股票型发起式基金基金合同》的有关规定,基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、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(包括权证、股指期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率 $\times$ 90%+一年期人民币定期存款利率(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》、《创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

#### 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确认。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；4、同一类

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

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

### 6.4.7 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 2017年06月30日

活期存款	9,020,541.67
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	0.00
合计	9,020,541.67

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	164,766,016.61	162,982,881.83	-1,783,134.78
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	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00
合计	164,766,016.61	162,982,881.83	-1,783,134.78

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于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

本基金于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 2017年06月30日
应收活期存款利息	1,783.99
应收定期存款利息	0.00
应收其他存款利息	0.00
应收结算备付金利息	34.50
应收债券利息	0.00
应收买入返售证券利息	0.00
应收申购款利息	0.00
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	19.60
合计	1,838.09

#### 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 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	75,741.65
银行间市场应付交易费用	0.00
合计	75,741.65

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.20
预提费用	66,944.66
合计	66,944.86

## 6.4.7.9 实收基金

## 6.4.7.9.1 创金合信优价成长股票A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信优价成长股票A)	本期2017年01月01日至2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	9,450,982.01	9,450,982.01
本期申购	148,005,992.37	148,005,992.37
本期赎回(以“-”号填列)	-187,355.90	-187,355.90
本期末	157,269,618.48	157,269,618.48

## 6.4.7.9.2 创金合信优价成长股票C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信优价成长股票C)	本期2017年01月01日至2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,383,235.78	3,383,235.78
本期申购	1,852,091.55	1,852,091.55
本期赎回(以“-”号填列)	-1,149,241.90	-1,149,241.90
本期末	4,086,085.43	4,086,085.43

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 创金合信优价成长股票A

单位：人民币元

项目 (创金合信优价成长股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,219.56	-232,768.29	-210,548.73
本期利润	8,709,428.32	-1,500,339.53	7,209,088.79
本期基金份额交易产生的变动数	762,414.69	2,707,154.82	3,469,569.51
其中：基金申购款	766,937.51	2,707,141.66	3,474,079.17

基金赎回款	-4,522.82	13.16	-4,509.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,494,062.57	974,047.00	10,468,109.57

## 6.4.7.10.2 创金合信优价成长股票C

单位：人民币元

项目 (创金合信优价成长股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,339.88	-83,266.65	-76,926.77
本期利润	224,812.20	81,931.70	306,743.90
本期基金份额交易产生的变动数	5,667.95	26,593.79	32,261.74
其中：基金申购款	27,576.27	33,477.81	61,054.08
基金赎回款	-21,908.32	-6,884.02	-28,792.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	236,820.03	25,258.84	262,078.87

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年06月30日
活期存款利息收入	24,148.96
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,329.96
其他	234.36
合计	28,713.28

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
----	-------------------------------

卖出股票成交总额	61,422,469.45
减：卖出股票成本总额	52,463,802.18
买卖股票差价收入	8,958,667.27

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,315,589.46
基金投资产生的股利收益	0.00
合计	1,315,589.46

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
1. 交易性金融资产	-1,418,407.83
——股票投资	-1,418,407.83
——债券投资	0.00
——资产支持证券投资	0.00
——基金投资	0.00
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	0.00
——权证投资	0.00
3. 其他	0.00
合计	-1,418,407.83

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
基金赎回费收入	3,531.42
合计	3,531.42

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
交易所市场交易费用	276,002.43
银行间市场交易费用	0.00
合计	276,002.43

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	49,588.57
汇划手续费	75.00
合计	67,019.66

#### 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	关联方与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

#### 6.4.10 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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本期末无应付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 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
	2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	892,714.08
其中：支付销售机构的客户维护费	8,237.92

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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
	2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	148,785.70

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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017年01月01日至2017年06月30日		
	创金合信优价成长股票	创金合信优价成长股票	合计

	A	C	
创金合信基金	-	7,556.83	7,556.83
第一创业证券	-	73.49	73.49
合计	-	7,630.32	7,630.32

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,仅就C类基金份额所代表的基金资产收取销售服务费。C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.5%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付,由登记机构代收,登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

创金合信优价成长股票A

份额单位:份

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2016年11月02日)持有的基金份额	5,000,450.09
报告期初持有的基金份额	5,000,450.09
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-

报告期末持有的基金份额	5,000,450.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.18%

创金合信优价成长股票C

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日（2016年11月02日）持有的基金份额	3,000,270.00
报告期初持有的基金份额	3,000,270.00
报告期内申购/买入总份额	-
报告期内因拆分变动份额	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	3,000,270.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	73.43%

**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**

本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司活期存款	9,020,541.67	24,148.96

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**

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
代码	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	说明
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新发流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新发流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新发流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新发流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新发流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
60361	君禾	2017-	2017-	新发	8.93	8.93	832	7,42	7,42	-

7	股份	06-23	07-03	流通受限				9.76	9.76	
---	----	-------	-------	------	--	--	--	------	------	--

#### 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

代码	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	备注说明
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项停牌	6.85	2017-08-21	8.22	553,000	3,791,326.00	3,788,050.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重

大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等利率债券。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等利率债券。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。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证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦在证券交易所上市交易，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2017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	9,020,541.67	-	-	-	9,020,541.67
结算备付金	76,815.20	-	-	-	76,815.20
存出保证金	43,455.41	-	-	-	43,455.41
交易性金融资产	-	-	-	162,982,881.83	162,982,881.83
应收证券清算款	-	-	-	2,217,665.20	2,217,665.20
应收利息	-	-	-	1,838.09	1,838.09
应收申购款	-	-	-	19,767.77	19,767.77
资产总计	9,140,812.28	-	-	165,222,152.89	174,362,965.17
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,838,109.12	1,838,109.12
应付赎回款	-	-	-	54,582.97	54,582.97
应付管理人报酬	-	-	-	205,699.43	205,699.43

应付托管费	-	-	-	34,283.24	34,283.24
应付销售服务费	-	-	-	1,711.55	1,711.55
应付交易费用	-	-	-	75,741.65	75,741.65
其他负债	-	-	-	66,944.86	66,944.86
负债总计	-	-	-	2,277,072.82	2,277,072.82
利率敏感度缺口	9,140,812.28	-	-	162,945,080.07	172,085,892.35
上年度末2016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	498,198.45	-	-	-	498,198.45
结算备付金	164,372.85	-	-	-	164,372.85
存出保证金	2,440.36	-	-	-	2,440.36
交易性金融资产	-	-	-	11,910,962.12	11,910,962.12
应收利息	-	-	-	192.71	192.71
应收申购款	-	-	-	500.00	500.00
资产总计	665,011.66	-	-	11,911,654.83	12,576,666.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	927.66	927.66
应付管理人报酬	-	-	-	16,097.84	16,097.84
应付托管费	-	-	-	2,682.95	2,682.95
应付销售服务费	-	-	-	1,441.89	1,441.89
应付交易费用	-	-	-	8,773.86	8,773.86
负债总计	-	-	-	29,924.20	29,924.20
利率敏感度缺口	665,011.66	-	-	11,881,730.63	12,546,742.29

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

市场利率的变动对基金资产净值无重大影响。

#### 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 2017年06月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价	占基金资产净

		资产净 值比例 (%)	值	值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	162,982,881.83	94.71	11,910,962.12	94.93
交易性金融资产-基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-债券投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	-	-	-	-
合计	162,982,881.83	94.71	11,910,962.12	94.93

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	9,444,276.77	-
比较基准下降5%资产净值变动	-9,444,276.77	-	

#### 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2017年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为159,071,148.73元，属于第二层次的余额为3,911,733.10

元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次11,651,026.12元，第二层次259,936.00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2017年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016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) 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	162,982,881.83	93.47
	其中：股票	162,982,881.83	93.47
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	9,097,356.87	5.22
7	其他各项资产	2,282,726.47	1.31
8	合计	174,362,965.17	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	83,427,148.82	48.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,309,448.45	1.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,250.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	26,660,820.39	15.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,139,433.87	7.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,712,522.00	5.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,722,258.30	16.11
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	-	-
	合计	162,982,881.83	94.71

## 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	000625	长安汽车	1,178,698	16,996,825.16	9.88
2	002152	广电运通	2,034,922	16,910,201.82	9.83
3	000069	华侨城 A	1,463,640	14,724,218.40	8.56
4	600054	黄山旅游	510,249	8,725,257.90	5.07
5	600138	中青旅	413,700	8,712,522.00	5.06
6	000063	中兴通讯	363,713	8,634,546.62	5.02
7	002202	金风科技	557,799	8,629,150.53	5.01
8	000800	一汽轿车	848,289	8,627,099.13	5.01
9	000550	江铃汽车	408,800	8,462,160.00	4.92
10	601111	中国国航	690,500	6,732,375.00	3.91
11	600029	南方航空	653,600	5,686,320.00	3.30
12	600115	东方航空	758,100	5,155,080.00	3.00
13	600804	鹏博士	287,419	5,101,687.25	2.96
14	601021	春秋航空	142,393	4,788,676.59	2.78
15	600498	烽火通信	170,444	4,320,755.40	2.51
16	603885	吉祥航空	283,160	4,298,368.80	2.50
17	603000	人民网	322,100	4,242,057.00	2.47
18	600050	中国联通	553,000	3,788,050.00	2.20
19	600198	大唐电信	272,090	3,474,589.30	2.02
20	601985	中国核电	423,745	3,309,448.45	1.92
21	600261	阳光照明	459,300	3,017,601.00	1.75
22	603008	喜临门	101,900	1,814,839.00	1.05

23	000651	格力电器	43,634	1,796,411.78	1.04
24	000888	峨眉山 A	140,200	1,780,540.00	1.03
25	002159	三特索道	73,523	1,764,552.00	1.03
26	000430	张家界	68,650	727,690.00	0.42
27	600332	白云山	13,100	380,424.00	0.22
28	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.03
29	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.03
30	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
31	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
32	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
33	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
34	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
35	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
36	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
37	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
38	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
39	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
40	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
41	002024	苏宁云商	1,000	11,250.00	0.01
42	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
43	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
44	300671	富满电子	942	7,639.62	-
45	603617	君禾股份	832	7,429.76	-
46	600276	恒瑞医药	120	6,070.80	-
47	002508	老板电器	130	5,652.40	-
48	603288	海天味业	100	4,078.00	-
49	000725	京东方 A	200	832.00	-

#### 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	000625	长安汽车	18,325,940.88	146.06
2	002152	广电运通	17,694,799.18	141.03
3	000651	格力电器	15,361,625.00	122.44
4	000550	江铃汽车	10,348,216.40	82.48
5	000069	华侨城 A	10,347,615.20	82.47
6	000800	一汽轿车	9,059,412.00	72.21
7	002202	金风科技	8,743,472.63	69.69
8	601985	中国核电	8,290,359.95	66.08
9	600138	中青旅	8,275,985.38	65.96
10	000063	中兴通讯	8,200,461.00	65.36
11	600276	恒瑞医药	7,837,912.94	62.47
12	600054	黄山旅游	7,583,533.50	60.44
13	603288	海天味业	6,320,763.55	50.38
14	601111	中国国航	5,919,032.00	47.18
15	600804	鹏博士	5,662,356.49	45.13
16	600498	烽火通信	5,497,866.23	43.82
17	600115	东方航空	5,391,798.00	42.97
18	603000	人民网	5,382,452.28	42.90
19	600029	南方航空	5,377,579.00	42.86
20	601021	春秋航空	5,143,706.66	41.00
21	600261	阳光照明	5,096,255.42	40.62
22	603885	吉祥航空	4,713,107.00	37.56
23	600198	大唐电信	4,275,511.05	34.08
24	600050	中国联通	3,791,326.00	30.22
25	600398	海澜之家	3,267,301.00	26.04
26	002159	三特索道	1,811,806.00	14.44
27	000888	峨眉山 A	1,461,392.00	11.65
28	603008	喜临门	1,444,451.00	11.51
29	000430	张家界	1,392,309.00	11.10

30	002508	老板电器	1,163,194.00	9.27
----	--------	------	--------------	------

注:本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	18,150,052.51	144.66
2	600276	恒瑞医药	8,765,096.67	69.86
3	603288	海天味业	7,602,087.18	60.59
4	601985	中国核电	5,947,470.99	47.40
5	000063	中兴通讯	4,337,128.02	34.57
6	600398	海澜之家	3,543,495.06	28.24
7	002508	老板电器	2,310,844.32	18.42
8	600261	阳光照明	1,698,957.00	13.54
9	600498	烽火通信	1,152,584.19	9.19
10	000725	京东方A	1,077,321.87	8.59
11	002152	广电运通	975,971.30	7.78
12	000430	张家界	824,252.50	6.57
13	000625	长安汽车	519,014.34	4.14
14	002563	森马服饰	342,252.86	2.73
15	601952	苏垦农发	195,948.36	1.56
16	601366	利群股份	160,469.00	1.28
17	601878	浙商证券	159,272.98	1.27
18	603113	金能科技	112,221.60	0.89
19	603920	世运电路	107,671.95	0.86
20	603980	吉华集团	105,138.46	0.84

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	204,954,129.72
---------------	----------------

卖出股票的收入（成交）总额	61,422,469.45
---------------	---------------

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

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

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 黄山旅游（600054）2016年7月12日公告：“公司总裁助理洪海平涉嫌违法正被有关部门执行指定居所监视居住。目前本公司生产经营运行正常。”

本基金投研人员分析认为：从目前可获取的公开信息看存在较大可能是公司总裁助理洪海平的个人违法行为，且洪海平在公司任职仅1年3个月任职时间较短对公司影响有限，此外洪海平也于2016年8月4日离职，不会对公司产生后续不良影响，公司也已声明了公司经营运行正常。通过后续跟踪研究，我们认为公司自2016年初开始对公司高管团队进行了逐步的更换，实质性推动了公司的国企改革，随着改革推进公司的管理能力和效率在逐步提升，经营逐步向好。同时，国内旅游行业近年来保持了较高的景气度，公司作为行业龙头之一，目前正处于国企改革逐步落地的过程中，未来效率提升空间较大，

目前估值合理，维持持有评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对黄山旅游进行了投资。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	43,455.41
2	应收证券清算款	2,217,665.20
3	应收股利	-
4	应收利息	1,838.09
5	应收申购款	19,767.77
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,282,726.47

### 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	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
创金 合信 优价 成长 股票A	207	759,756.61	151,569,728.9 6	96.38	5,699,889.52	3.62
创金 合信 优价 成长 股票C	214	19,093.86	3,000,270.00	73.43	1,085,815.43	26.57
合计	406	397,427.84	154,569,998.9 6	95.79	6,785,704.95	4.21

## 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	创金合信优价成 长股票A	3,328,681.45	2.12
	创金合信优价成 长股票C	0.00	-
	合计	3,328,681.45	2.06

## 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	创金合信优价成长 股票A	>100
	创金合信优价成长 股票C	0.00

	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信优价成长股票A	>100
	创金合信优价成长股票C	0.00
	合计	>100

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	8,000,720.09	4.96	8,000,720.09	4.96	36月
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	3,316,286.24	2.06	2,001,178.45	1.24	36月
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,317,006.33	7.01	10,001,898.54	6.20	-

#### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信优价成长股票	创金合信优价成长股票
--	------------	------------

	A	C
基金合同生效日(2016年11月02日)基金份额总额	7,106,920.17	3,080,802.48
本报告期期初基金份额总额	9,450,982.01	3,383,235.78
本报告期期间基金总申购份额	148,005,992.37	1,852,091.55
减:本报告期期间基金总赎回份额	187,355.90	1,149,241.90
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	157,269,618.48	4,086,085.43

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华安证券	2	-	0.00	-	0.00	-
天风证券	2	-	0.00	-	0.00	-
第一创业证券	2	-	0.00	-	0.00	-
金元证券	2	-	0.00	-	0.00	-
招商证券	2	-	0.00	-	0.00	-
兴业证券	2	-	0.00	-	0.00	-
国信证券	2	1,432,431.32	0.54	1,307.01	0.68	-
广发证券	2	-	0.00	-	0.00	-
申万宏源	2	-	0.00	-	0.00	-
银河证券	2	-	0.00	-	0.00	-
中信建投证券	2	-	0.00	-	0.00	-
东兴证券	2	-	0.00	-	0.00	-
中泰证券	2	-	0.00	-	0.00	-
中信证券	2	-	0.00	-	0.00	-
长江证券	2	-	0.00	-	0.00	-
中银国际证券	2	263,171,578.87	99.46	189,802.43	99.32	-
华泰证券	2	-	0.00	-	0.00	-
中投证券	2	-	0.00	-	0.00	-
安信证券	2	-	0.00	-	0.00	-

注：交易单元的选择标准和程序：

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

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金

运作高度保密的要求；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，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信证券，天风证券，申万宏源证券，兴业证券，广发证券，安信证券、中投证券、华泰证券、长江证券9家券商的18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	占当期债券成交总量的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购交易成交总量的比例 (%)	成交金额	占当期权证交易成交总量的比例 (%)	成交金额	占当期基金交易成交总量的比例 (%)
华安证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	0.00	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	134,00	100.00	-	-	-	-

			0,000.00					
华泰证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	0.00	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	公司官网、上海证券报	2017-01-01
2	创金合信基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式证券投资基金申购及赎回金额的公告	公司官网、上海证券报	2017-01-04
3	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构的公告	公司官网、上海证券报	2017-01-07
4	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加蛋卷基金为代销机构的公告	公司官网、上海证券报	2017-01-24
5	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加平安证券为代销机构的公告	公司官网、上海证券报	2017-02-09
6	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告	公司官网、上海证券报	2017-02-16
7	创金合信基金管理有限公司关于直销柜台申购费率优惠政策调整的公告	公司官网、上海证券报	2017-02-22
8	创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金暂停大额	公司官网、上海证券报	2017-02-24

	申购的公告		
9	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加上海基煜为代销机构的公告	公司官网、上海证券报	2017-03-16
10	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金增加汇成基金为代销机构的公告	公司官网、上海证券报	2017-03-24
11	创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金2017年第1季度报告	公司官网、上海证券报	2017-04-21
12	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加安信证券为代销机构的公告	公司官网、上海证券报	2017-04-26
13	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金增加前海凯恩斯为代销机构的公告	公司官网、上海证券报	2017-06-05
14	创金合信基金管理有限公司关于开通旗下部分开放式基金转换业务的公告	公司官网、上海证券报	2017-06-13
15	创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金（2017年第1号）招募说明书（更新）	公司官网、上海证券报	2017-06-15
16	创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金（2017年第1号）招募说明书（摘要）	公司官网、上海证券报	2017-06-15
17	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金及其代销机构一览表公告	公司官网、上海证券报	2017-06-23
18	创金合信基金管理有限公司	公司官网、上海证券报	2017-06-28

	关于旗下部分开放式基金增加代销机构暨参加代销机构费率优惠活动的公告		
--	-----------------------------------	--	--

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20170101 -20170222	3,005,069.97	311,216.27	0.00	3,316,286.24	2.06
	2	20170101 -20170222	8,000,720.09	0.00	0.00	8,000,720.09	4.96
	3	20170223 -20170630	0.00	146,569,278.87	0.00	146,569,278.87	90.84

#### 产品特有风险

本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：

#### 1、大额申购风险

在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

#### 2、大额赎回风险

(1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；

(2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响；

(3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不

利影响，影响基金的投资运作；

（4）因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信优价成长股票型发起式证券投资基金2017年半年度报告原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

### 12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日