

# 创金合信量化多因子股票型证券投资基金

## 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	6
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	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	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	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	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	62
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	62
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	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64

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.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信量化多因子股票型证券投资基金	
基金简称	创金合信量化多因子股票	
基金主代码	002210	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年01月22日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,551,376,481.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C
下属分级基金的交易代码	002210	003865
报告期末下属分级基金的份额总额	1,463,466,274.82份	87,910,206.60份

注:本基金于2017年1月6日起,增设C类基金份额,本基金原有基金份额全部自动化归为A累基金份额。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的同时,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金,股票投资部分占基金资产的比例不低于80%。本基金将采取定量与定性相结合的方法,运用“自上而下”的资产配置逻辑,形成对大类资产预期收益及风险的判断,进而确定资产配置的具体比例。其中,本基金在进行资产配置决策时将主要考虑宏观经济、政策预期、产业经济、市场情绪、投资者行为等因素。
业绩比较基准	中证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。	
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	郭明
	联系电话	0755-23838908	010-66105799
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	custody@icbc.com.cn
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	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
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区中心区福华一路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)	
	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C
本期已实现收益	-223,637,818.39	-6,972,125.58
本期利润	-176,912,021.70	-7,480,291.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1172	-0.1527
本期加权平均净值利润率	-9.93%	-13.26%
本期基金份额净值增长率	-9.78%	-11.02%
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	167,767,964.08	9,796,552.35
期末可供分配基金份额利润	0.1146	0.1114
期末基金资产净值	1,647,195,710.13	98,659,740.14
期末基金份额净值	1.1260	1.1220
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	12.60%	-11.02%

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。

4. 本基金C类份额自2017年1月6日起增设，截至报告期末，本基金C类成立不满半年，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

##### 创金合信量化多因子股票A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.26%	1.05%	5.02%	0.84%	-0.76%	0.21%
过去三个月	-7.25%	1.10%	-3.20%	0.92%	-4.05%	0.18%
过去六个月	-9.78%	1.00%	-0.78%	0.81%	-9.00%	0.19%
过去一年	0.36%	0.95%	2.33%	0.82%	-1.97%	0.13%
自基金合同生效起至今	12.60%	1.00%	7.21%	1.29%	5.39%	-0.29%

##### 创金合信量化多因子股票C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.18%	1.04%	5.02%	0.84%	-0.84%	0.20%
过去三个月	-7.50%	1.09%	-3.20%	0.92%	-4.30%	0.17%
自基金合同生效起至今	-11.02%	1.00%	-2.71%	0.81%	-8.31%	0.19%

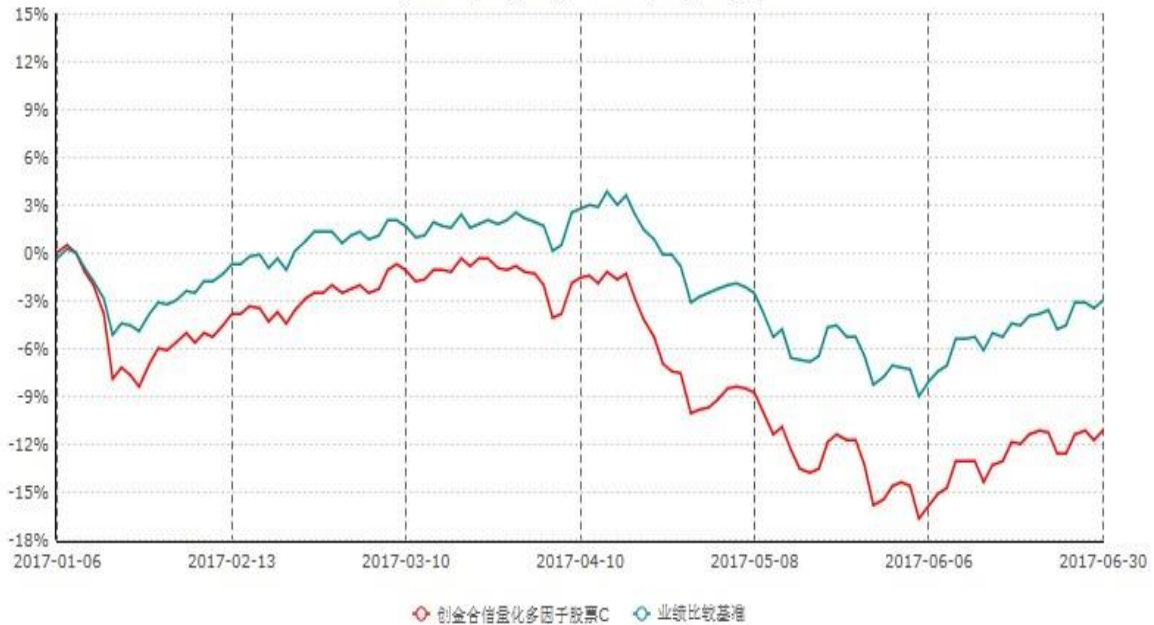
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



创金合信量化多因子股票A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01月22日-2017年06月30日)



创金合信量化多因子股票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  
(2017年01月06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		
程志田	基金经理、量化投资部总监	2016-01-22	-	10年	程志田先生，中国国籍，金融学硕士，2006年7月加入长江证券股份有限公司任高级研究经理。2009年7月加入国海证券股份有限公司任金融工程总监。2011年7月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，于2011年1月15日至2013年4月15日担任大摩深证300基金的基金经理。2013年9月加入泰康资产管理有限责任公司任量化投资总监。2015年5月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化投资部总监、基金经理。
庞世恩	基金经理	2016-01-25	-	6年	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、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共36次，为基金在调仓时点因选股模型和其他基金选股模型产生分歧而发生的反向交易，未对当天的股票价格产生冲击。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2017年上半年，我们严格依据量化模型进行投资，并严格进行风险管理。一方面，我们按照量化选股模型进行股票组合构建；另一方面，仓位管理上，我们按照量化择时模型进行操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值增长率为-9.78%，A类份额同期业绩比较基准收益率为-0.78%；C类净值增长率为-11.02%，C类份额同期业绩比较基准收益率为-2.71%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在过去的半年里，经济数据超预期。2季度GDP及6月份工业、投资、消费、进出口增长均超预期，工业生产延续强势，收入回升支撑消费，企业盈利改善。目前CPI水平较低，因为通胀引发货币政策收紧的可能性很小。经历了过去两年市场调整，当前股市估值略偏低；增量资金进场意愿不明显，市场依然存在较多的结构性机会。

#### 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2017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：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	147,877,256.53	106,762,583.54
结算备付金		65,913,600.92	11,184,474.88
存出保证金		10,846,803.24	303,926.67
交易性金融资产	6.4.7.2	1,531,292,935.06	1,673,429,432.06
其中：股票投资		1,531,292,935.06	1,673,429,432.06
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		11,028,100.06	30,012,675.00
应收利息	6.4.7.5	143,223.57	33,006.64
应收股利		-	-
应收申购款		1,714,094.19	14,654,682.93
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,768,816,013.57	1,836,380,781.72
<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		-	-
应付赎回款		17,279,291.25	967,767.56
应付管理人报酬		2,124,916.91	2,069,861.38
应付托管费		354,152.81	344,976.87
应付销售服务费		52,951.28	-
应付交易费用	6.4.7.6	3,030,551.32	1,226,311.47
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	118,699.73	156,105.07
负债合计		22,960,563.30	4,765,022.35
<b>所有者权益:</b>			

实收基金	6.4.7.8	1,551,376,481.42	1,467,906,594.71
未分配利润	6.4.7.9	194,478,968.85	363,709,164.66
所有者权益合计		1,745,855,450.27	1,831,615,759.37
负债和所有者权益总计		1,768,816,013.57	1,836,380,781.72

注:1. 报告截止日2017年6月30日, 基金份额总额1,551,376,481.42份, 其中下属A类基金份额1,463,466,274.82份, C类基金份额87,910,206.60份。下属A类基金份额净值1.126元, C类基金份额净值1.122元。

2. 本基金合同生效日为2016年1月22日, 上年度可比期间为2016年1月22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: 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	上年度可比期间 2016年01月22日(基金合同生效日)至2016年06月30日
一、收入		-147,840,406.37	11,895,294.16
1. 利息收入		1,321,592.59	247,043.63
其中: 存款利息收入	6.4.7.10	652,191.96	62,644.83
债券利息收入		52,650.03	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		616,750.60	184,398.80
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-198,117,630.69	7,919,422.49
其中: 股票投资收益	6.4.7.11	-194,803,472.62	7,447,134.27

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 2	118,188.07	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 3	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-9,962,972.73	-
股利收益	6.4.7.1 5	6,530,626.59	472,288.22
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.1 6	46,217,631.10	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)	6.4.7.1 7	2,738,000.63	1,256,331.85
<b>减：二、费用</b>		36,551,906.50	1,193,107.44
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	13,633,997.84	575,752.40
2. 托管费	6.4.10. 2.2	2,272,333.01	95,958.76
3. 销售服务费	6.4.10. 2.3	187,450.96	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	20,358,236.69	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	6.4.7.1 9	99,888.00	70,449.58
<b>三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)</b>		-184,392,312.87	10,702,186.72
减：所得税费用		-	-



四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-184,392,312.87	10,702,186.72
-------------------	--	-----------------	---------------

注：本基金合同生效日为2016年1月22日，上年度可比期间为2016年1月22日至2016年6月30日。

### 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：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)	1,467,906,594.71	363,709,164.66	1,831,615,759.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-184,392,312.87	-184,392,312.87
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)	83,469,886.71	15,162,117.06	98,632,003.77
其中：1. 基金申购款	745,547,927.17	147,508,571.10	893,056,498.27
2. 基金赎回款	-662,078,040.46	-132,346,454.04	-794,424,494.50
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)	1,551,376,481.42	194,478,968.85	1,745,855,450.27
项 目	上年度可比期间 2016年01月22日（基金合同生效日）至2016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)	202,639,215.4	-	202,639,215.47

值)	7		
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

注：本基金合同生效日为2016年1月22日，上年度可比期间为2016年1月22日至2016年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

创金合信量化多因子股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]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。本基金于2017年1月6日起，增设C类基金份额，本基金原有基金份额全部自

动化归为A累基金份额。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 $\times$ 90%+2%。

#### 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

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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	147,877,256.53	
定期存款	-	
其中：存款期限1-3个月	-	
其他存款	-	
合计	147,877,256.53	

##### 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		1,544,318,366.18	1,531,292,935.06	-13,025,431.12
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		1,544,318,366.18	1,531,292,935.06	-13,025,431.12

#### 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

本基金本报告期末及上年度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	31,747.28
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	111,200.69
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	275.60
合计	143,223.57

#### 6.4.7.6 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	3,030,301.32
银行间市场应付交易费用	250.00
合计	3,030,551.32

#### 6.4.7.7 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	19,522.59
预提费用	99,177.14
合计	118,699.73

#### 6.4.7.8 实收基金

##### 6.4.7.8.1 创金合信量化多因子股票A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信量化多因子股票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	1,467,906,594.71	1,467,906,594.71
本期申购	634,708,469.49	634,708,469.49
本期赎回(以“-”号填列)	-639,148,789.38	-639,148,789.38
本期末	1,463,466,274.82	1,463,466,274.82

##### 6.4.7.8.2 创金合信量化多因子股票C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信量化多因子股票C)	本期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	-	-
本期申购	110,839,457.68	110,839,457.68
本期赎回(以“-”号填列)	-22,929,251.08	-22,929,251.08
本期末	87,910,206.60	87,910,206.60

注:申购含红利再投、转换入份(金)额,赎回含转换出份(金)额。

## 6.4.7.9 未分配利润

## 6.4.7.9.1 创金合信量化多因子股票A

单位：人民币元

项目 (创金合信量化多因子股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	390,006,881.16	-26,297,716.50	363,709,164.66
本期利润	-223,637,818.39	46,725,796.69	-176,912,021.70
本期基金份额交易产生的变动数	1,398,901.31	-4,466,608.96	-3,067,707.65
其中：基金申购款	129,066,454.38	-3,113,052.17	125,953,402.21
基金赎回款	-127,667,553.07	-1,353,556.79	-129,021,109.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	167,767,964.08	15,961,471.23	183,729,435.31

## 6.4.7.9.2 创金合信量化多因子股票C

单位：人民币元

项目 (创金合信量化多因子股票C)	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	-6,972,125.58	-508,165.59	-7,480,291.17
本期基金份额交易产	16,768,677.93	1,461,146.78	18,229,824.71

生的变动数			
其中：基金申购款	20,380,529.77	1,174,639.12	21,555,168.89
基金赎回款	-3,611,851.84	286,507.66	-3,325,344.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,796,552.35	952,981.19	10,749,533.54

#### 6.4.7.10 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	399,241.14
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	248,022.55
其他	4,928.27
合计	652,191.96

#### 6.4.7.11 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	9,456,403,987.17
减：卖出股票成本总额	9,651,207,459.79
买卖股票差价收入	-194,803,472.62

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	118,188.07



债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	118,188.07

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	43,012,676.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	42,836,600.00
减：应收利息总额	57,888.74
买卖债券差价收入	118,188.07

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金于本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
股指期货	-9,962,972.73

#### 6.4.7.15 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	6,530,626.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,530,626.59

## 6.4.7.16 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	46,988,716.37
—— 股票投资	46,988,716.37
—— 债券投资	-
—— 资产支持证券投资	-
—— 基金投资	-
—— 贵金属投资	-
—— 其他	-
2. 衍生工具	-
—— 权证投资	-
3. 其他	-771,085.27
合计	46,217,631.10

## 6.4.7.17 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	2,738,000.63
合计	2,738,000.63

## 6.4.7.18 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	20,357,736.69

银行间市场交易费用	500.00
合计	20,358,236.69

#### 6.4.7.19 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	49,588.57
信息披露费	49,588.57
汇划手续费	710.86
合计	99,888.00

#### 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（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

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		上年度可比期间 2016年01月22日（基金合同 生效日）至2016年06月30 日	
	成交金 额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	成交金 额	占当期股票成 交总额的比例 (%)
第一创业证券股份有限公司	2,806,7 90,729. 64	14.84	121,03 8,725.9 8	33.51

## 6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本期末及上年度可比期间均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

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		上年度可比期间 2016年01月22日（基金合 同生效日）至2016年06月3 0日	
	债券回 购成交 金额	占当期债券回 购成交总额的 比例(%)	成交金 额	占当期债券回 购成交总额的 比例(%)
第一创业证券股份有限公司	800,00 0,000.0 0	17.71	1,149,0 00,000. 00	67.99

## 6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本期末及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
第一创业证券股份有限公司	1,851,102.90	20.09	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月22日（基金合同生效日）至2016年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
第一创业证券	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。

## 6.4.10.2 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	上年度可比期间 2016年01月22日（基金合同 生效日）至2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,633,997.84	575,752.40
其中：支付销售机构的客户维护费	7,793,323.07	320,378.48

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发

送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日 至2017年06月30 日	上年度可比期间 2016年01月22日（基金合同生 效日）至2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,272,333.01	95,958.76

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年06月30日		
	创金合信量化多因子股 票A	创金合信量化多因子股 票C	合计
创金合信基金	-	329.07	329.07
工商银行	-	216.47	216.47
合计	-	545.54	545.54

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金的基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金

管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值×0.75%/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

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日 至2017年06月30 日		上年度可比期间 2016年01月22日（基金合 同生效日）至2016年06月3 0日	
	期末余 额	当期利 息收入	期末余额	当期利息收 入
中国工商银行股份有限公司活期存款	147,877,256.53	399,241.14	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

本基金本报告期末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

本基金于本期末未进行利润分配。

## 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	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新发 流通	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-



				受限						
--	--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

#### 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
600603	广汇物流	2017-06-15	重大事项停牌	11.81	2017-07-27	11.71	730,909	9,839,017.80	8,632,035.29	-
000862	银星能源	2017-03-13	重大事项停牌	7.90	-	-	858,889	7,044,709.80	6,785,223.10	-
600057	象屿股份	2017-06-27	重大事项停牌	10.17	2017-07-04	10.17	542,667	5,487,826.68	5,518,923.39	-
601313	江南嘉捷	2017-06-12	重大事项停牌	8.79	-	-	590,615	5,376,806.23	5,191,505.85	-
002696	百洋股份	2017-06-22	重大事项停牌	20.87	2017-07-03	21.74	245,300	4,658,029.99	5,119,411.00	-
600602	云赛智联	2017-06-22	重大事项停牌	7.51	2017-07-04	7.80	597,417	4,920,406.64	4,486,601.67	-
000662	天夏智慧	2017-06-05	重大事项停牌	16.00	-	-	246,100	4,065,622.11	3,937,600.00	-
000038	深大通	2017-05-12	重大事项停牌	31.74	-	-	114,686	4,705,797.67	3,640,133.64	-
300092	科新机电	2017-04-14	重大事项	12.70	-	-	190,460	2,578,608.60	2,418,848.84	-

			停牌					2.02	2.00	
300108	双龙股份	2017-05-12	重大事项停牌	7.75	2017-08-04	8.35	270,700	2,380,749.65	2,097,925.00	-
002526	山东矿机	2017-06-12	重大事项停牌	7.47	2017-07-03	7.58	260,500	1,889,281.19	1,945,935.00	-
002006	精功科技	2017-05-22	重大事项停牌	7.91	-	-	211,855	1,742,096.78	1,675,773.05	-
300267	尔康制药	2017-05-10	重大事项停牌	11.46	-	-	109,900	1,392,962.61	1,259,454.00	-
002748	世龙实业	2017-06-29	重大事项停牌	19.45	2017-07-05	20.00	58,500	1,088,085.29	1,137,825.00	-
300461	田中精机	2017-05-10	重大事项停牌	64.25	-	-	17,000	1,166,911.90	1,092,250.00	-
300500	启迪设计	2017-04-17	重大事项停牌	34.03	2017-07-12	30.64	26,800	997,210.13	912,004.00	-
600653	申华控股	2017-05-08	重大事项停牌	3.26	-	-	174,100	588,536.21	567,566.00	-
000610	西安旅游	2017-05-22	重大事项停牌	11.43	2017-07-24	10.71	24,300	275,227.41	277,749.00	-
600462	九有股份	2017-03-24	重大事项停牌	8.14	2017-07-19	7.33	29,800	241,925.00	242,572.00	-

### 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。

##### 6.4.13.3 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	147,877,25 6.53	-	-	-	147,877,256. 53
结算备付金	65,913,60 0.92	-	-	-	65,913,600.9 2
存出保证金	10,846,80	-	-	-	10,846,803.2

	3.24				4
交易性金融资产	-	-	-	1,531,292,935.06	1,531,292,935.06
应收证券清算款	-	-	-	11,028,100.06	11,028,100.06
应收利息	-	-	-	143,223.57	143,223.57
应收申购款	-	-	-	1,714,094.19	1,714,094.19
资产总计	224,637,660.69	-	-	1,544,178,352.88	1,768,816,013.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,279,291.25	17,279,291.25
应付管理人报酬	-	-	-	2,124,916.91	2,124,916.91
应付托管费	-	-	-	354,152.81	354,152.81
应付销售服务费	-	-	-	52,951.28	52,951.28
应付交易费用	-	-	-	3,030,551.32	3,030,551.32
其他负债	-	-	-	118,699.73	118,699.73
负债总计	-	-	-	22,960,563.30	22,960,563.30
利率敏感度缺口	224,637,660.69	-	-	1,521,217,789.58	1,745,855,450.27
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	106,762,583.54	-	-	-	106,762,583.54
结算备付金	11,184,474.88	-	-	-	11,184,474.88
存出保证金	303,926.67	-	-	-	303,926.67
交易性金融资产	-	-	-	1,673,429,432.06	1,673,429,432.06
应收证券清算款	-	-	-	30,012,675.0	30,012,675.0

				0	0
应收利息	-	-	-	33,006.64	33,006.64
应收申购款	-	-	-	14,654,682.93	14,654,682.93
资产总计	118,250,985.09	-	-	1,718,129,796.63	1,836,380,781.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	967,767.56	967,767.56
应付管理人报酬	-	-	-	2,069,861.38	2,069,861.38
应付托管费	-	-	-	344,976.87	344,976.87
应付交易费用	-	-	-	1,226,311.47	1,226,311.47
其他负债	-	-	-	156,105.07	156,105.07
负债总计	-	-	-	4,765,022.35	4,765,022.35
利率敏感度缺口	118,250,985.09	-	-	1,713,364,774.28	1,831,615,759.37

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	1,531,292,935.06	87.71	1,673,429,432.06	91.36
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,531,292,935.06	87.71	1,673,429,432.06	91.36

#### 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	上年度末

		2017年06月30日	2016年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	89,962,718.59	-
	比较基准下降5%资产净值变动	-89,962,718.59	-

#### 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1,474,229,922.97元，属于第二层次的余额为 57,063,012.09元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次1,636,281,318.02元，第二层次37,148,114.04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	1,531,292,935.06	86.57
	其中：股票	1,531,292,935.06	86.57
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	213,790,857.45	12.09
7	其他各项资产	23,732,221.06	1.34
8	合计	1,768,816,013.57	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	21,015,922.96	1.20
B	采矿业	27,214,467.06	1.56
C	制造业	1,015,691,582.79	58.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,954,586.34	4.87

E	建筑业	19,003,269.16	1.09
F	批发和零售业	107,402,566.20	6.15
G	交通运输、仓储和邮政业	39,112,858.54	2.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,901,579.02	3.14
J	金融业	4,403,697.90	0.25
K	房地产业	59,841,870.76	3.43
L	租赁和商务服务业	32,125,054.72	1.84
M	科学研究和技术服务业	27,483,048.36	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	12,124,933.46	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,930,646.81	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,188,463.69	0.87
S	综合	8,898,387.29	0.51
	合计	1,531,292,935.06	87.71

### 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	600603	广汇物流	730,909	8,632,035.29	0.49
2	603567	珍宝岛	468,643	7,887,261.69	0.45
3	000761	本钢板材	1,503,200	7,861,736.00	0.45
4	300360	炬华科技	522,038	7,856,671.90	0.45
5	300179	四方达	1,200,697	7,852,558.38	0.45
6	600723	XD首商股	879,430	7,844,515.60	0.45
7	300120	经纬电材	596,635	7,839,783.90	0.45
8	600438	通威股份	1,400,100	7,812,558.00	0.45
9	600736	苏州高新	1,103,379	7,800,889.53	0.45

10	000990	诚志股份	487,840	7,795,683.20	0.45
11	600302	标准股份	939,062	7,794,214.60	0.45
12	300193	佳士科技	937,897	7,793,924.07	0.45
13	300129	泰胜风能	1,098,700	7,789,783.00	0.45
14	300194	福安药业	1,120,800	7,789,560.00	0.45
15	002452	长高集团	1,132,300	7,778,901.00	0.45
16	000949	新乡化纤	1,682,500	7,773,150.00	0.45
17	002496	辉丰股份	1,566,994	7,772,290.24	0.45
18	000589	黔轮胎 A	1,400,100	7,770,555.00	0.45
19	600960	渤海活塞	1,017,880	7,766,424.40	0.44
20	603599	广信股份	512,700	7,757,151.00	0.44
21	600499	科达洁能	976,900	7,756,586.00	0.44
22	600982	宁波热电	1,602,600	7,756,584.00	0.44
23	600229	城市传媒	826,885	7,747,912.45	0.44
24	601677	明泰铝业	567,866	7,745,692.24	0.44
25	600052	浙江广厦	1,532,900	7,741,145.00	0.44
26	002064	华峰氨纶	1,605,900	7,740,438.00	0.44
27	002463	沪电股份	1,699,400	7,732,270.00	0.44
28	002093	国脉科技	878,394	7,729,867.20	0.44
29	000570	苏常柴 A	1,103,297	7,723,079.00	0.44
30	600218	全柴动力	859,013	7,722,526.87	0.44
31	600810	神马股份	973,208	7,717,539.44	0.44
32	002247	帝龙文化	587,619	7,709,561.28	0.44
33	600035	楚天高速	1,397,602	7,700,787.02	0.44
34	600382	广东明珠	533,846	7,692,720.86	0.44
35	002187	广百股份	616,380	7,686,258.60	0.44
36	600979	广安爱众	1,341,900	7,675,668.00	0.44
37	600641	万业企业	680,596	7,595,451.36	0.44
38	002712	思美传媒	349,589	7,544,130.62	0.43
39	600105	永鼎股份	933,900	7,536,573.00	0.43
40	600969	郴电国际	524,608	7,449,433.60	0.43

41	002536	西泵股份	595,349	7,370,420.62	0.42
42	002171	楚江新材	495,436	7,347,315.88	0.42
43	300282	汇冠股份	345,152	7,282,707.20	0.42
44	601010	文峰股份	1,725,400	7,263,934.00	0.42
45	300306	远方光电	419,031	7,261,807.23	0.42
46	300046	台基股份	387,376	7,243,931.20	0.41
47	300468	四方精创	162,443	7,243,333.37	0.41
48	603808	歌力思	242,427	7,156,445.04	0.41
49	002566	益盛药业	637,684	7,154,814.48	0.41
50	000962	东方钽业	793,065	7,121,723.70	0.41
51	600269	赣粤高速	1,361,300	7,092,373.00	0.41
52	300040	九洲电气	697,352	7,071,149.28	0.41
53	601188	龙江交通	1,461,300	7,043,466.00	0.40
54	601137	博威合金	601,955	6,838,208.80	0.39
55	000862	银星能源	858,889	6,785,223.10	0.39
56	002173	创新医疗	428,200	6,769,842.00	0.39
57	300233	金城医药	319,092	6,697,741.08	0.38
58	600567	山鹰纸业	1,850,800	6,625,864.00	0.38
59	300158	振东制药	404,902	6,567,510.44	0.38
60	000739	普洛药业	892,400	6,550,216.00	0.38
61	002430	杭氧股份	740,365	6,507,808.35	0.37
62	000886	海南高速	1,310,100	6,498,096.00	0.37
63	002088	鲁阳节能	541,001	6,475,781.97	0.37
64	002220	天宝股份	765,472	6,445,274.24	0.37
65	600981	汇鸿集团	866,352	6,419,668.32	0.37
66	601616	广电电气	1,370,212	6,398,890.04	0.37
67	601113	华鼎股份	758,500	6,394,155.00	0.37
68	002398	建研集团	494,800	6,363,128.00	0.36
69	002528	英飞拓	1,061,755	6,296,207.15	0.36
70	601567	三星医疗	603,040	6,283,676.80	0.36
71	002039	黔源电力	429,003	6,237,703.62	0.36

72	600573	惠泉啤酒	613,572	6,221,620.08	0.36
73	002469	三维工程	766,998	6,182,003.88	0.35
74	300167	迪威视讯	526,300	6,178,762.00	0.35
75	300303	聚飞光电	1,426,300	6,175,879.00	0.35
76	603869	北部湾旅	226,726	6,169,214.46	0.35
77	002003	伟星股份	589,330	6,158,498.50	0.35
78	600180	瑞茂通	438,315	6,153,942.60	0.35
79	600429	三元股份	942,092	6,151,860.76	0.35
80	002337	赛象科技	1,052,557	6,146,932.88	0.35
81	300365	恒华科技	171,700	6,129,690.00	0.35
82	002775	文科园林	301,916	6,116,818.16	0.35
83	300138	晨光生物	465,739	6,110,495.68	0.35
84	000417	合肥百货	739,500	6,100,875.00	0.35
85	000713	丰乐种业	744,529	6,097,692.51	0.35
86	002593	日上集团	1,158,422	6,093,299.72	0.35
87	300456	耐威科技	163,257	6,086,220.96	0.35
88	000420	吉林化纤	1,988,555	6,084,978.30	0.35
89	000612	焦作万方	753,695	6,067,244.75	0.35
90	600864	哈投股份	729,395	6,061,272.45	0.35
91	002374	丽鹏股份	1,029,500	6,053,460.00	0.35
92	600356	恒丰纸业	608,170	6,045,209.80	0.35
93	002324	普利特	224,637	6,038,242.56	0.35
94	300123	太阳鸟	510,500	6,013,690.00	0.34
95	600479	千金药业	414,000	5,990,580.00	0.34
96	600721	百花村	420,234	5,975,727.48	0.34
97	600512	腾达建设	1,204,100	5,936,213.00	0.34
98	000890	法尔胜	726,320	5,912,244.80	0.34
99	600746	江苏索普	544,400	5,868,632.00	0.34
100	002181	粤传媒	1,076,527	5,824,011.07	0.33
101	002087	新野纺织	997,500	5,635,875.00	0.32
102	300094	国联水产	760,558	5,590,101.30	0.32

103	600057	象屿股份	542,667	5,518,923.39	0.32
104	603518	维格娜丝	225,146	5,507,071.16	0.32
105	600231	凌钢股份	1,649,500	5,443,350.00	0.31
106	600713	南京医药	768,715	5,404,066.45	0.31
107	603311	金海环境	269,401	5,396,102.03	0.31
108	300214	日科化学	801,989	5,381,346.19	0.31
109	300154	瑞凌股份	631,503	5,355,145.44	0.31
110	000055	方大集团	727,900	5,299,112.00	0.30
111	601313	江南嘉捷	590,615	5,191,505.85	0.30
112	603611	诺力股份	196,490	5,177,511.50	0.30
113	002696	百洋股份	245,300	5,119,411.00	0.29
114	300307	慈星股份	499,900	5,058,988.00	0.29
115	300391	康跃科技	319,350	5,026,569.00	0.29
116	000415	渤海金控	738,900	4,972,797.00	0.28
117	600510	黑牡丹	645,617	4,945,426.22	0.28
118	002386	天原集团	688,176	4,906,694.88	0.28
119	002705	新宝股份	314,370	4,724,981.10	0.27
120	600748	上实发展	644,317	4,639,082.40	0.27
121	002587	奥拓电子	602,000	4,539,080.00	0.26
122	600602	云赛智联	597,417	4,486,601.67	0.26
123	600167	联美控股	208,965	4,438,416.60	0.25
124	600695	绿庭投资	669,255	4,403,697.90	0.25
125	000813	德展健康	498,300	4,300,329.00	0.25
126	600883	博闻科技	368,213	4,297,045.71	0.25
127	002380	科远股份	229,395	4,232,337.75	0.24
128	002683	宏大爆破	467,700	4,218,654.00	0.24
129	002338	奥普光电	121,955	4,185,495.60	0.24
130	600345	长江通信	201,000	4,142,610.00	0.24
131	002309	中利集团	331,022	4,141,085.22	0.24
132	002225	濮耐股份	750,060	4,087,827.00	0.23
133	600792	云煤能源	884,688	4,078,411.68	0.23

134	002521	齐峰新材	405,300	4,004,364.00	0.23
135	000662	天夏智慧	246,100	3,937,600.00	0.23
136	603968	醋化股份	174,201	3,912,554.46	0.22
137	000823	超声电子	270,709	3,903,623.78	0.22
138	002626	金达威	272,993	3,890,150.25	0.22
139	600509	天富能源	506,600	3,855,226.00	0.22
140	603167	渤海轮渡	354,400	3,852,328.00	0.22
141	002680	长生生物	251,503	3,845,480.87	0.22
142	000929	兰州黄河	274,711	3,821,230.01	0.22
143	002091	江苏国泰	397,526	3,796,373.30	0.22
144	000978	桂林旅游	405,200	3,752,152.00	0.21
145	000936	华西股份	525,355	3,687,992.10	0.21
146	600306	商业城	266,051	3,658,201.25	0.21
147	002776	柏堡龙	157,600	3,653,168.00	0.21
148	300126	锐奇股份	417,640	3,645,997.20	0.21
149	000498	山东路桥	509,400	3,642,210.00	0.21
150	000038	深大通	114,686	3,640,133.64	0.21
151	601518	吉林高速	949,300	3,626,326.00	0.21
152	300358	楚天科技	254,100	3,626,007.00	0.21
153	300488	恒锋工具	108,508	3,624,167.20	0.21
154	000030	富奥股份	405,359	3,623,909.46	0.21
155	002026	山东威达	399,402	3,622,576.14	0.21
156	002394	联发股份	245,305	3,613,342.65	0.21
157	002763	汇洁股份	125,451	3,606,716.25	0.21
158	600090	同济堂	384,363	3,601,481.31	0.21
159	002100	天康生物	448,470	3,601,214.10	0.21
160	000919	金陵药业	332,800	3,600,896.00	0.21
161	600051	宁波联合	376,300	3,597,428.00	0.21
162	603123	翠微股份	404,793	3,594,561.84	0.21
163	600697	欧亚集团	127,600	3,593,216.00	0.21
164	002406	远东传动	443,500	3,587,915.00	0.21

165	603309	维力医疗	201,679	3,587,869.41	0.21
166	002328	新朋股份	433,800	3,587,526.00	0.21
167	600628	XD新世界	310,600	3,587,430.00	0.21
168	000685	中山公用	327,407	3,585,106.65	0.21
169	601339	百隆东方	602,480	3,584,756.00	0.21
170	002029	七匹狼	374,300	3,582,051.00	0.21
171	300396	迪瑞医疗	103,718	3,581,382.54	0.21
172	601218	吉鑫科技	815,300	3,579,167.00	0.21
173	600644	乐山电力	471,500	3,578,685.00	0.20
174	000708	大冶特钢	308,500	3,578,600.00	0.20
175	300305	裕兴股份	399,020	3,575,219.20	0.20
176	002144	宏达高科	210,200	3,573,400.00	0.20
177	002433	太安堂	384,800	3,559,400.00	0.20
178	600331	宏达股份	650,700	3,552,822.00	0.20
179	002160	常铝股份	497,710	3,543,695.20	0.20
180	000046	泛海控股	400,100	3,492,873.00	0.20
181	300161	华中数控	181,084	3,455,082.72	0.20
182	000756	新华制药	225,952	3,429,951.36	0.20
183	002770	科迪乳业	636,300	3,327,849.00	0.19
184	000528	柳工	383,700	3,315,168.00	0.19
185	600966	博汇纸业	636,600	3,303,954.00	0.19
186	600117	西宁特钢	649,801	3,274,997.04	0.19
187	000833	贵糖股份	433,000	3,182,550.00	0.18
188	002632	道明光学	398,531	3,156,365.52	0.18
189	002686	亿利达	229,808	3,143,773.44	0.18
190	002370	亚太药业	106,738	3,129,558.16	0.18
191	002391	长青股份	213,500	3,125,640.00	0.18
192	002258	利尔化学	240,900	3,044,976.00	0.17
193	601666	平煤股份	575,800	3,034,466.00	0.17
194	600348	阳泉煤业	447,338	3,032,951.64	0.17
195	002317	众生药业	243,500	3,024,270.00	0.17



196	002534	杭锅股份	319,120	3,018,875.20	0.17
197	000637	茂化实华	452,700	3,005,928.00	0.17
198	002445	中南文化	231,500	2,974,775.00	0.17
199	002381	双箭股份	335,400	2,931,396.00	0.17
200	300373	扬杰科技	139,543	2,811,791.45	0.16
201	002604	龙力生物	299,100	2,784,621.00	0.16
202	002111	威海广泰	153,500	2,782,955.00	0.16
203	600461	洪城水业	384,500	2,772,245.00	0.16
204	000715	中兴商业	246,814	2,769,253.08	0.16
205	600513	联环药业	270,356	2,760,334.76	0.16
206	600668	尖峰集团	160,200	2,752,236.00	0.16
207	002615	哈尔斯	243,250	2,748,725.00	0.16
208	000026	飞亚达 A	220,100	2,738,044.00	0.16
209	002290	中科新材	160,300	2,630,523.00	0.15
210	603818	曲美家居	165,048	2,629,214.64	0.15
211	000043	中航地产	275,000	2,629,000.00	0.15
212	300277	海联讯	303,029	2,627,261.43	0.15
213	600888	新疆众和	422,360	2,610,184.80	0.15
214	600619	海立股份	239,800	2,609,024.00	0.15
215	000636	风华高科	302,681	2,575,815.31	0.15
216	002101	广东鸿图	107,272	2,562,728.08	0.15
217	000733	振华科技	158,600	2,521,740.00	0.14
218	002084	海鸥卫浴	281,300	2,500,757.00	0.14
219	000705	浙江震元	241,480	2,487,244.00	0.14
220	603018	中设集团	76,700	2,484,313.00	0.14
221	601368	绿城水务	251,395	2,473,726.80	0.14
222	300390	天华超净	265,900	2,438,303.00	0.14
223	300182	捷成股份	255,000	2,437,800.00	0.14
224	300092	科新机电	190,460	2,418,842.00	0.14
225	300248	新开普	148,987	2,409,119.79	0.14
226	002777	久远银海	34,300	2,387,280.00	0.14

227	600515	海航基础	224,795	2,308,644.65	0.13
228	600862	中航高科	236,200	2,288,778.00	0.13
229	002147	新光圆成	146,800	2,281,272.00	0.13
230	002203	海亮股份	273,300	2,224,662.00	0.13
231	601107	四川成渝	470,466	2,220,599.52	0.13
232	002327	富安娜	264,637	2,199,133.47	0.13
233	300165	天瑞仪器	267,202	2,191,056.40	0.13
234	002150	通润装备	186,052	2,186,111.00	0.13
235	300108	双龙股份	270,700	2,097,925.00	0.12
236	002645	华宏科技	116,738	2,080,271.16	0.12
237	000959	首钢股份	294,900	2,061,351.00	0.12
238	300338	开元股份	93,000	1,999,500.00	0.11
239	600114	东睦股份	113,002	1,977,535.00	0.11
240	600311	荣华实业	369,300	1,975,755.00	0.11
241	600389	江山股份	119,138	1,975,308.04	0.11
242	000564	供销大集	301,700	1,964,067.00	0.11
243	300239	东宝生物	297,500	1,963,500.00	0.11
244	000900	现代投资	213,100	1,960,520.00	0.11
245	000796	凯撒旅游	160,675	1,947,381.00	0.11
246	002526	山东矿机	260,500	1,945,935.00	0.11
247	300143	星普医科	70,375	1,945,868.75	0.11
248	002737	葵花药业	63,138	1,944,650.40	0.11
249	002646	青青稞酒	111,314	1,943,542.44	0.11
250	600470	六国化工	305,586	1,943,526.96	0.11
251	600505	西昌电力	231,760	1,939,831.20	0.11
252	000688	建新矿业	241,660	1,933,280.00	0.11
253	601100	恒立液压	118,634	1,932,547.86	0.11
254	002731	萃华珠宝	90,708	1,932,080.40	0.11
255	600390	五矿资本	159,500	1,931,545.00	0.11
256	002535	林州重机	365,800	1,931,424.00	0.11
257	300067	安诺其	307,000	1,931,030.00	0.11

258	600661	新南洋	89,923	1,930,646.81	0.11
259	300185	通裕重工	738,600	1,927,746.00	0.11
260	002581	未名医药	94,188	1,926,144.60	0.11
261	002270	华明装备	179,673	1,926,094.56	0.11
262	000968	蓝焰控股	132,727	1,919,232.42	0.11
263	600551	时代出版	121,500	1,918,485.00	0.11
264	000552	靖远煤电	537,000	1,917,090.00	0.11
265	002286	保龄宝	153,700	1,916,639.00	0.11
266	002133	广宇集团	345,862	1,916,075.48	0.11
267	600395	盘江股份	261,300	1,915,329.00	0.11
268	000837	秦川机床	265,200	1,914,744.00	0.11
269	603017	中衡设计	108,800	1,912,704.00	0.11
270	601566	九牧王	118,600	1,911,832.00	0.11
271	300341	麦迪电气	220,281	1,905,430.65	0.11
272	600531	豫光金铅	258,500	1,902,560.00	0.11
273	002529	海源机械	107,892	1,888,110.00	0.11
274	002441	众业达	163,147	1,885,979.32	0.11
275	002753	永东股份	101,318	1,881,475.26	0.11
276	002688	金河生物	204,300	1,816,227.00	0.10
277	002630	华西能源	153,400	1,777,906.00	0.10
278	600665	天地源	353,223	1,762,582.77	0.10
279	600789	鲁抗医药	219,700	1,737,827.00	0.10
280	600067	冠城大通	251,700	1,729,179.00	0.10
281	000782	美达股份	181,000	1,705,020.00	0.10
282	002714	牧原股份	62,520	1,701,794.40	0.10
283	002228	合兴包装	364,900	1,700,434.00	0.10
284	002126	银轮股份	168,800	1,698,128.00	0.10
285	002238	天威视讯	142,300	1,693,370.00	0.10
286	600076	康欣新材	188,700	1,692,639.00	0.10
287	300102	乾照光电	197,500	1,686,650.00	0.10
288	002687	乔治白	218,980	1,686,146.00	0.10

289	002768	国恩股份	80,200	1,680,190.00	0.10
290	002006	精功科技	211,855	1,675,773.05	0.10
291	002193	如意集团	113,935	1,674,844.50	0.10
292	002397	梦洁股份	250,137	1,670,915.16	0.10
293	300489	中飞股份	70,600	1,670,396.00	0.10
294	600742	一汽富维	87,400	1,670,214.00	0.10
295	300312	邦讯技术	131,800	1,668,588.00	0.10
296	600889	南京化纤	175,809	1,668,427.41	0.10
297	002376	新北洋	121,600	1,668,352.00	0.10
298	000719	大地传媒	159,868	1,667,423.24	0.10
299	603188	亚邦股份	95,600	1,667,264.00	0.10
300	002440	闰土股份	109,200	1,666,392.00	0.10
301	600726	华电能源	371,900	1,666,112.00	0.10
302	600308	华泰股份	293,300	1,665,944.00	0.10
303	002548	金新农	137,900	1,665,832.00	0.10
304	300050	世纪鼎利	165,400	1,665,578.00	0.10
305	600711	盛屯矿业	250,600	1,663,984.00	0.10
306	603116	红蜻蜓	90,500	1,663,390.00	0.10
307	600694	大商股份	42,675	1,663,044.75	0.10
308	600073	上海梅林	174,130	1,662,941.50	0.10
309	002293	罗莱生活	145,100	1,662,846.00	0.10
310	300375	鹏翎股份	84,100	1,662,657.00	0.10
311	000650	仁和药业	278,000	1,662,440.00	0.10
312	002419	天虹股份	115,600	1,662,328.00	0.10
313	000665	湖北广电	136,800	1,662,120.00	0.10
314	002367	康力电梯	142,300	1,662,064.00	0.10
315	002454	松芝股份	131,900	1,661,940.00	0.10
316	300170	汉得信息	161,100	1,660,941.00	0.10
317	600483	福能股份	160,100	1,660,237.00	0.10
318	601179	中国西电	298,600	1,660,216.00	0.10
319	000726	鲁泰 A	139,900	1,659,214.00	0.10

320	002118	紫鑫药业	242,900	1,659,007.00	0.10
321	600267	海正药业	142,000	1,658,560.00	0.09
322	600523	贵航股份	89,600	1,658,496.00	0.09
323	600508	上海能源	142,100	1,658,307.00	0.09
324	600377	宁沪高速	169,200	1,658,160.00	0.09
325	002533	金杯电工	219,300	1,657,908.00	0.09
326	600327	大东方	202,325	1,657,041.75	0.09
327	601579	会稽山	136,199	1,656,179.84	0.09
328	002653	海思科	127,235	1,655,327.35	0.09
329	600466	蓝光发展	191,800	1,655,234.00	0.09
330	603118	共进股份	121,400	1,654,682.00	0.09
331	002033	丽江旅游	161,900	1,654,618.00	0.09
332	600168	武汉控股	183,607	1,654,299.07	0.09
333	600285	羚锐制药	147,300	1,654,179.00	0.09
334	002067	景兴纸业	281,800	1,654,166.00	0.09
335	300132	青松股份	203,700	1,654,044.00	0.09
336	300039	上海凯宝	227,400	1,653,198.00	0.09
337	600163	中闽能源	347,900	1,652,525.00	0.09
338	603936	博敏电子	62,700	1,652,145.00	0.09
339	603001	奥康国际	87,900	1,651,641.00	0.09
340	002042	华孚色纺	154,500	1,651,605.00	0.09
341	000598	兴蓉环境	293,800	1,651,156.00	0.09
342	000898	鞍钢股份	291,700	1,651,022.00	0.09
343	002083	孚日股份	216,100	1,651,004.00	0.09
344	300270	中威电子	140,946	1,650,477.66	0.09
345	600894	广日股份	139,300	1,649,312.00	0.09
346	000531	穗恒运 A	173,220	1,649,054.40	0.09
347	000698	沈阳化工	252,500	1,648,825.00	0.09
348	600642	申能股份	261,700	1,648,710.00	0.09
349	002559	亚威股份	151,500	1,648,320.00	0.09
350	000926	福星股份	135,100	1,648,220.00	0.09

351	300443	金雷风电	76,900	1,647,198.00	0.09
352	300171	东富龙	140,900	1,647,121.00	0.09
353	000419	通程控股	232,573	1,646,616.84	0.09
354	000601	韶能股份	230,900	1,646,317.00	0.09
355	300339	润和软件	130,602	1,645,585.20	0.09
356	002080	中材科技	83,022	1,645,496.04	0.09
357	002267	陕天然气	187,200	1,645,488.00	0.09
358	600757	长江传媒	220,100	1,644,147.00	0.09
359	601636	旗滨集团	364,500	1,643,895.00	0.09
360	002403	爱仕达	124,700	1,643,546.00	0.09
361	601388	怡球资源	463,900	1,642,206.00	0.09
362	600761	安徽合力	125,205	1,640,185.50	0.09
363	000789	万年青	231,300	1,639,917.00	0.09
364	002078	太阳纸业	223,100	1,639,785.00	0.09
365	600335	国机汽车	137,100	1,639,716.00	0.09
366	600261	阳光照明	249,400	1,638,558.00	0.09
367	000421	南京公用	224,300	1,637,390.00	0.09
368	002017	东信和平	147,000	1,636,110.00	0.09
369	300231	银信科技	123,800	1,634,160.00	0.09
370	600188	兖州煤业	133,500	1,634,040.00	0.09
371	300196	长海股份	54,886	1,632,858.50	0.09
372	603989	艾华集团	41,300	1,620,612.00	0.09
373	600708	光明地产	224,500	1,490,680.00	0.09
374	600565	迪马股份	266,100	1,466,211.00	0.08
375	300241	瑞丰光电	113,940	1,456,153.20	0.08
376	002152	广电运通	173,200	1,439,292.00	0.08
377	002765	蓝黛传动	130,800	1,424,412.00	0.08
378	600615	丰华股份	88,200	1,396,206.00	0.08
379	600328	兰太实业	119,400	1,389,816.00	0.08
380	600367	红星发展	127,500	1,388,475.00	0.08
381	600305	恒顺醋业	135,300	1,388,178.00	0.08

382	600169	太原重工	355,000	1,370,300.00	0.08
383	300230	永利股份	82,074	1,357,503.96	0.08
384	002404	嘉欣丝绸	174,000	1,341,540.00	0.08
385	002546	新联电子	220,800	1,313,760.00	0.08
386	300269	联建光电	63,700	1,275,911.00	0.07
387	300267	尔康制药	109,900	1,259,454.00	0.07
388	002362	汉王科技	59,100	1,200,321.00	0.07
389	002068	黑猫股份	135,900	1,142,919.00	0.07
390	603025	大豪科技	43,100	1,137,840.00	0.07
391	002748	世龙实业	58,500	1,137,825.00	0.07
392	300387	富邦股份	57,300	1,134,540.00	0.06
393	600093	易见股份	83,900	1,126,777.00	0.06
394	000703	恒逸石化	78,600	1,119,264.00	0.06
395	300483	沃施股份	33,371	1,116,259.95	0.06
396	002048	宁波华翔	53,500	1,116,010.00	0.06
397	002020	京新药业	94,100	1,115,085.00	0.06
398	600039	四川路桥	267,200	1,111,552.00	0.06
399	601678	滨化股份	159,700	1,109,915.00	0.06
400	300254	仟源医药	78,075	1,109,445.75	0.06
401	300452	山河药辅	40,300	1,108,250.00	0.06
402	603338	浙江鼎力	16,800	1,107,624.00	0.06
403	600211	西藏药业	25,000	1,106,750.00	0.06
404	600123	兰花科创	145,100	1,105,662.00	0.06
405	002275	桂林三金	62,401	1,105,121.71	0.06
406	002237	恒邦股份	105,200	1,103,548.00	0.06
407	002540	亚太科技	156,200	1,102,772.00	0.06
408	600380	健康元	121,300	1,101,404.00	0.06
409	603788	宁波高发	25,600	1,101,312.00	0.06
410	600020	中原高速	218,400	1,100,736.00	0.06
411	600081	东风科技	88,317	1,099,546.65	0.06
412	601700	风范股份	183,400	1,098,566.00	0.06

413	600986	科达股份	81,000	1,098,360.00	0.06
414	600243	青海华鼎	124,300	1,097,569.00	0.06
415	000701	厦门信达	87,800	1,097,500.00	0.06
416	601199	江南水务	159,700	1,097,139.00	0.06
417	600284	浦东建设	102,300	1,096,656.00	0.06
418	300470	日机密封	32,056	1,095,994.64	0.06
419	002557	洽洽食品	75,700	1,095,379.00	0.06
420	600101	明星电力	111,101	1,094,344.85	0.06
421	002073	软控股份	129,000	1,093,920.00	0.06
422	000731	四川美丰	145,800	1,093,500.00	0.06
423	002226	江南化工	155,300	1,093,312.00	0.06
424	300461	田中精机	17,000	1,092,250.00	0.06
425	600782	新钢股份	299,100	1,091,715.00	0.06
426	600808	马钢股份	307,900	1,089,966.00	0.06
427	000591	太阳能	211,800	1,088,652.00	0.06
428	000530	大冷股份	151,000	1,087,200.00	0.06
429	603015	弘讯科技	103,122	1,072,468.80	0.06
430	300500	启迪设计	26,800	912,004.00	0.05
431	002212	南洋股份	67,100	856,867.00	0.05
432	600861	北京城乡	65,600	842,960.00	0.05
433	002334	英威腾	113,900	825,775.00	0.05
434	002320	海峡股份	58,000	822,440.00	0.05
435	300112	万讯自控	69,800	811,774.00	0.05
436	600819	耀皮玻璃	106,428	716,260.44	0.04
437	601857	中国石油	85,200	655,188.00	0.04
438	600520	中发科技	31,800	588,300.00	0.03
439	002511	中顺洁柔	43,100	570,213.00	0.03
440	000903	云内动力	125,200	569,660.00	0.03
441	600653	申华控股	174,100	567,566.00	0.03
442	603883	老百姓	11,600	564,340.00	0.03
443	600598	北大荒	50,500	561,055.00	0.03



444	600368	五洲交通	96,500	558,735.00	0.03
445	000597	东北制药	49,900	557,882.00	0.03
446	002385	大北农	88,600	557,294.00	0.03
447	300417	南华仪器	20,600	556,200.00	0.03
448	600363	联创光电	39,700	556,197.00	0.03
449	600741	华域汽车	22,900	555,096.00	0.03
450	002184	海得控制	39,644	555,016.00	0.03
451	601233	桐昆股份	40,000	554,400.00	0.03
452	002713	东易日盛	27,200	554,064.00	0.03
453	600236	桂冠电力	97,200	554,040.00	0.03
454	002019	亿帆医药	33,200	553,776.00	0.03
455	002435	长江润发	32,300	553,622.00	0.03
456	300445	康斯特	24,941	552,443.15	0.03
457	002191	劲嘉股份	59,000	552,240.00	0.03
458	603088	宁波精达	15,000	552,150.00	0.03
459	600033	福建高速	144,800	551,688.00	0.03
460	600219	南山铝业	162,700	551,553.00	0.03
461	600850	华东电脑	25,800	551,346.00	0.03
462	002014	永新股份	43,700	551,057.00	0.03
463	002401	中远海科	41,900	550,985.00	0.03
464	600843	上工申贝	42,200	550,710.00	0.03
465	601699	潞安环能	70,400	550,528.00	0.03
466	000012	南玻 A	59,000	550,470.00	0.03
467	000667	美好置业	166,300	550,453.00	0.03
468	601515	东风股份	48,700	550,310.00	0.03
469	300394	天孚通信	21,500	550,185.00	0.03
470	002666	德联集团	86,900	550,077.00	0.03
471	600089	特变电工	53,200	549,556.00	0.03
472	300118	东方日升	39,100	549,355.00	0.03
473	300079	数码视讯	93,900	549,315.00	0.03
474	300235	方直科技	33,300	549,117.00	0.03

475	600422	昆药集团	48,400	548,856.00	0.03
476	300184	力源信息	44,100	548,604.00	0.03
477	002502	骅威文化	58,400	548,376.00	0.03
478	600530	交大昂立	97,000	548,050.00	0.03
479	600252	中恒集团	135,500	547,420.00	0.03
480	001696	宗申动力	72,300	547,311.00	0.03
481	600973	宝胜股份	97,700	547,120.00	0.03
482	600075	新疆天业	62,700	546,744.00	0.03
483	300435	中泰股份	39,700	546,669.00	0.03
484	601996	丰林集团	127,100	546,530.00	0.03
485	002740	爱迪尔	52,000	546,520.00	0.03
486	300025	华星创业	69,402	546,193.74	0.03
487	600846	同济科技	66,800	545,756.00	0.03
488	300026	红日药业	115,800	545,418.00	0.03
489	002563	森马服饰	64,300	545,264.00	0.03
490	600729	重庆百货	20,300	544,852.00	0.03
491	000429	粤高速 A	63,800	544,852.00	0.03
492	000830	鲁西化工	78,900	544,410.00	0.03
493	000821	京山轻机	41,000	544,070.00	0.03
494	002009	天奇股份	47,600	543,592.00	0.03
495	300121	阳谷华泰	39,200	540,960.00	0.03
496	002758	华通医药	38,501	540,554.04	0.03
497	002472	双环传动	49,000	537,530.00	0.03
498	300455	康拓红外	32,661	396,504.54	0.02
499	000916	华北高速	58,800	379,848.00	0.02
500	000525	红太阳	15,200	282,872.00	0.02
501	000952	广济药业	18,800	282,564.00	0.02
502	002538	司尔特	31,100	279,589.00	0.02
503	000759	中百集团	31,838	279,537.64	0.02
504	000610	西安旅游	24,300	277,749.00	0.02
505	600235	民丰特纸	35,800	275,660.00	0.02

506	002004	华邦健康	35,200	275,616.00	0.02
507	002188	巴士在线	10,700	274,990.00	0.02
508	601208	东材科技	39,000	274,560.00	0.02
509	600768	宁波富邦	17,100	274,284.00	0.02
510	603027	千禾味业	14,800	273,652.00	0.02
511	603606	东方电缆	22,700	272,854.00	0.02
512	002159	三特索道	11,300	271,200.00	0.02
513	002061	江山化工	28,600	271,128.00	0.02
514	000609	绵石投资	17,900	266,352.00	0.02
515	600462	九有股份	29,800	242,572.00	0.01
516	300472	新元科技	4,340	118,482.00	0.01
517	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	-
518	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	-
519	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	-
520	603380	易德龙	1,298	35,370.50	-
521	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	-
522	002881	美格智能	989	22,608.54	-
523	603679	华体科技	809	21,438.50	-
524	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	-
525	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	-
526	603933	睿能科技	857	17,311.40	-
527	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	-
528	300669	沪宁股份	841	14,650.22	-
529	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	-
530	603286	日盈电子	890	13,528.00	-
531	300672	国科微	1,257	10,659.36	-
532	603331	百达精工	999	9,620.37	-
533	300671	富满电子	942	7,639.62	-
534	603617	君禾股份	832	7,429.76	-

#### 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	300456	耐威科技	24,405,601.31	1.33
2	000046	泛海控股	23,817,730.57	1.30
3	600982	宁波热电	23,542,223.95	1.29
4	002369	卓翼科技	23,235,338.54	1.27
5	000886	海南高速	23,035,131.53	1.26
6	002171	楚江新材	22,658,659.59	1.24
7	603567	珍宝岛	22,580,381.33	1.23
8	600713	南京医药	22,499,807.17	1.23
9	300365	恒华科技	22,305,417.21	1.22
10	600218	全柴动力	22,132,342.64	1.21
11	600883	博闻科技	21,666,921.19	1.18
12	000949	新乡化纤	21,340,641.69	1.17
13	300277	海联讯	21,072,358.99	1.15
14	000739	普洛药业	21,004,956.72	1.15
15	600090	同济堂	20,929,292.62	1.14
16	300120	经纬电材	20,824,701.09	1.14
17	002337	赛象科技	20,620,549.96	1.13
18	000415	渤海金控	20,608,401.27	1.13
19	002150	通润装备	20,591,823.12	1.12
20	002181	粤传媒	20,409,939.63	1.11

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	300082	奥克股份	24,456,153.56	1.34

2	002369	卓翼科技	23,469,086.17	1.28
3	002350	北京科锐	22,611,821.18	1.23
4	300389	艾比森	22,193,260.41	1.21
5	002150	通润装备	21,972,995.27	1.20
6	300365	恒华科技	21,705,430.51	1.19
7	600713	南京医药	21,654,411.31	1.18
8	002511	中顺洁柔	21,570,207.95	1.18
9	600665	天地源	21,488,757.44	1.17
10	000046	泛海控股	20,494,782.92	1.12
11	000739	普洛药业	20,386,847.75	1.11
12	600057	象屿股份	19,708,304.15	1.08
13	600335	国机汽车	19,674,767.01	1.07
14	000949	新乡化纤	19,667,197.70	1.07
15	000666	经纬纺机	19,557,221.92	1.07
16	002370	亚太药业	19,475,574.58	1.06
17	002420	毅昌股份	19,433,520.85	1.06
18	000591	太阳能	19,153,511.43	1.05
19	300130	新国都	19,017,754.52	1.04
20	002661	克明面业	18,879,741.31	1.03

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	9,462,082,246.42
卖出股票的收入(成交)总额	9,456,403,987.17

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**

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1709	IC1709	12	14,452,320.00	-418,001.74	符合本基金的收益风险特征
IC1712	IC1712	29	34,282,640.00	-353,083.53	符合本基金的收益风险特征
公允价值变动总额合计（元）					-771,085.27
股指期货投资本期收益（元）					-9,962,972.73
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-771,085.27

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金投资于股指期货，均以套期保值为目的，包括多头套保和空头套保。本报告期进行了少量的多头套保。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

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

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	10,846,803.24
2	应收证券清算款	11,028,100.06
3	应收股利	-
4	应收利息	143,223.57
5	应收申购款	1,714,094.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,732,221.06

### 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。

#### 7.12.5.1 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	流通受限部分公允价值	占基金净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600603	广汇物流	8,632,035.29	0.49	重大事项停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
创金合信量化多因子股票A	65,170	22,456.13	122,634,950.80	8.38	1,340,831,324.02	91.62
创金合信量化多因子股票C	17,521	5,017.42	26,833,631.48	30.52	61,076,575.12	69.48
合计	80,772	19,206.86	149,468,582.28	9.63	1,401,907,899.14	90.37

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	创金合信量化多因子股票A	2,379,034.16	0.16
	创金合信量化多因子股票C	50,756.42	0.06
	合计	2,429,790.58	0.16

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	------	-------------------



本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	创金合信量化多因子股票A	0~10
	创金合信量化多因子股票C	0.00
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信量化多因子股票A	0.00
	创金合信量化多因子股票C	0.00
	合计	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信量化多因子股票A	创金合信量化多因子股票C
基金合同生效日(2016年01月22日)基金份额总额	202,639,215.47	-
本报告期期初基金份额总额	1,467,906,594.71	-
本报告期期间基金总申购份额	634,708,469.49	110,839,457.68
减：本报告期期间基金总赎回份额	639,148,789.38	22,929,251.08
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	1,463,466,274.82	87,910,206.60

## § 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 (%)	
第一创业证券	2	2,806,790,729.64	14.84	1,851,102.90	20.09	-
兴业证券	2	2,145,932,758.17	11.35	898,567.82	9.75	-
金元证券	2	228,836,175.86	1.21	48,348.33	0.52	-
招商证券	2	1,671,406,274.87	8.84	691,470.25	7.50	-
国信证券	2	142,297,402.60	0.75	69,610.76	0.76	-
银河证券	2	986,904,793.47	5.22	701,982.21	7.62	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

中信建投证券	2	2,454,538,505.74	12.98	2,136,723.24	23.19	-
东兴证券	2	344,106,452.05	1.82	114,035.27	1.24	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	4,563,639,484.07	24.13	1,568,843.15	17.02	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	3,569,459,642.72	18.87	1,135,279.98	12.32	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	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	成交金额	占当期债券回	成交	占当期权证交	成交	占当期基金交

		交总量的比例 (%)		购交易成交总额的比例 (%)	金额	易成交总额的比例 (%)	金额	易成交总额的比例 (%)
第一创业证券	-	-	800,000,000.00	17.71	-	-	-	-
兴业证券	-	-	1,055,000,000.00	23.36	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	3,085,971.00	100.00	10,000,000.00	0.22	-	-	-	-
国信证券	-	-	25,000,000.00	0.55	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	85,000,000.00	1.88	-	-	-	-
东兴证券	-	-	70,000,000.00	1.55	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	2,040,000,000.00	45.16	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	432,000,000.00	9.56	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信基金管理有限公司关于创金合信量化多因子股票型证券投资基金增设基金份额及修改基金合同的公告	公司官网、证券时报	2017-01-04
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、证券时报	2017-01-04
3	创金合信量化多因子股票型证券投资基金C关于增加招商银行为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-01-04
4	创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同	公司官网、证券时报	2017-01-04
5	创金合信量化多因子股票型证券投资基金托管协议	公司官网、证券时报	2017-01-04
6	创金合信量化多因子股票型证券投资基金C调整申购、赎回金额的公告	公司官网、证券时报	2017-01-05
7	创金合信基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购和赎回份额额度及最低持有份额额度的公告	公司官网、证券时报	2017-01-18
8	创金合信量化多因子股票型	公司官网、证券时报	2017-01-23

	证券投资基金2016年第4季度报告		
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蛋卷基金为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-01-24
10	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、证券时报	2017-02-09
11	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、证券时报	2017-02-16
12	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、证券时报	2017-02-22
13	创金合信量化多因子股票型证券投资基金（2017年第1号）招募说明书（更新）	公司官网、证券时报	2017-03-08
14	创金合信量化多因子股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第1号）	公司官网、证券时报	2017-03-08
15	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、证券时报	2017-03-24
16	创金合信量化多因子股票型证券投资基金2016年年度报告	公司官网、证券时报	2017-03-27
17	创金合信量化多因子股票型证券投资基金2016年年度报告摘要	公司官网、证券时报	2017-03-27

18	创金合信量化多因子股票型证券投资基金2017年第1季度报告	公司官网、证券时报	2017-04-21
19	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、证券时报	2017-04-26
20	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中银国际证券申购费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-06-01
21	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中银国际证券定期定额投资费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-06-05
22	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、证券时报	2017-06-05
23	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、证券时报	2017-06-13
24	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的公告	公司官网、证券时报	2017-06-23
25	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加代销机构暨参加代销机构费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-06-28

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信量化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](http://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