

创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

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:招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。

基金托管人招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..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现..... | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告..... | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 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..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 13 |
| §5 托管人报告..... | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 13 |
| 5.3 托管人对本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..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| §7 投资组合报告..... | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 42 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 44 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 44 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 45 |

| | |
|---|----|
| 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..... | 46 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 46 |
| §10 重大事件揭示..... | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 46 |
| 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..... | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 47 |
| 10.8 其他重大事件..... | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 50 |
| §12 备查文件目录..... | 50 |
| 12.1 备查文件目录..... | 50 |
| 12.2 存放地点..... | 50 |
| 12.3 查阅方式..... | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|----------------------|----------------|
| 基金名称 | 创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 创金合信鑫回报混合 | |
| 基金主代码 | 003190 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年08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 | 招商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 497,337,637.67份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信鑫回报混合 A | 创金合信鑫回报混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003190 | 003191 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 497,253,144.09份 | 84,493.58份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 追求基金资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金在资产配置过程中采取“自上而下”的分析框架,基金管理人基于定量与定性相结合的分析方法,综合宏观数据、经济政策、货币政策、市场估值等因素,形成各资产类别预期收益与预期风险的判断,并进而确定股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×30% + 一年期人民币定期存款利率(税后)×70% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于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 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于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 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 梁绍锋 | 张燕 |
| | 联系电话 | 0755-23838908 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | liangshaofeng@cjhxfund.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-868-0666 | 95555 |
| 传真 | | 0755-25832571 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区福华一路 15 号投行大厦 15 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 518000 | 518040 |
| 法定代表人 | | 刘学民 | 李建红 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|----|----|------|
|----|----|------|

| | | |
|--------|--------------|--------------------------|
| 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) | |
|---------------|------------------------------|------------|
| | 创金合信鑫回报混合A | 创金合信鑫回报混合C |
| 本期已实现收益 | -11,804.06 | 110.08 |
| 本期利润 | -1,214,384.28 | -295.56 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0024 | -0.0025 |
| 本期加权平均净值利润率 | -0.24% | -0.25% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.30% | -0.30% |
| 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 | 627,520.32 | -534.66 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0013 | -0.0063 |
| 期末基金资产净值 | 497,880,664.41 | 83,958.92 |
| 期末基金份额净值 | 1.001 | 0.994 |
| 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 | 0.10% | -0.60% |

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

创金合信鑫回报混合A

| 阶段 | 份额净 | 份额 | 业绩比较 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|-----|----|------|-------|-----|-----|
|----|-----|----|------|-------|-----|-----|

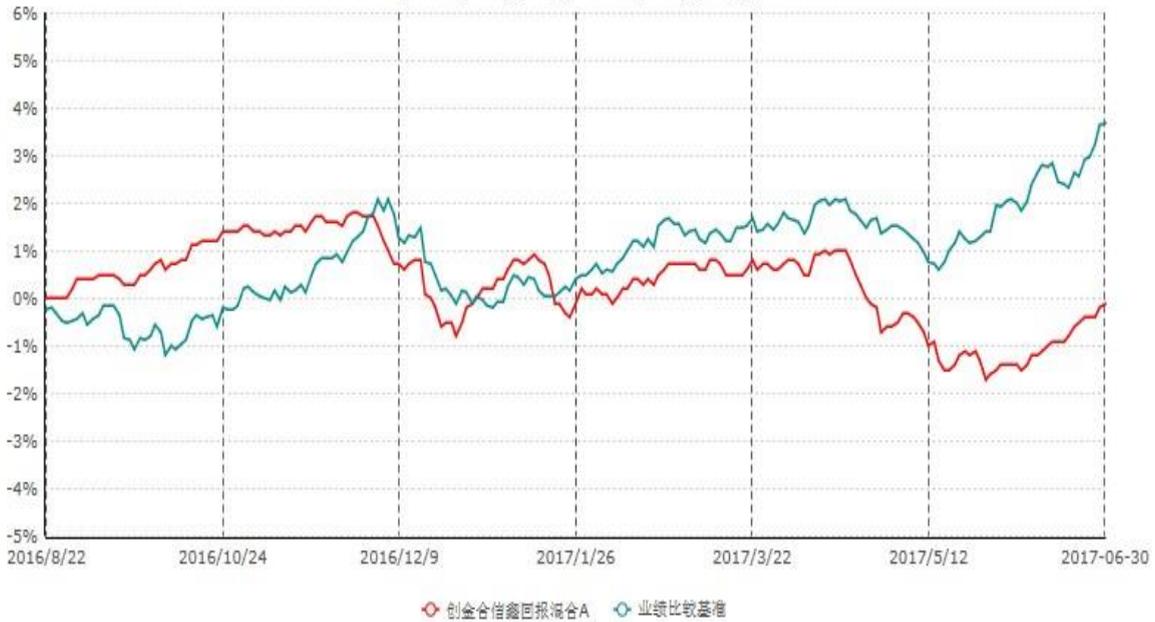
| | 值增长率① | 净值增长率标准差② | 基准收益率③ | 准收益率标准差④ | | |
|------------|--------|-----------|--------|----------|--------|--------|
| 过去一个月 | 1.52% | 0.08% | 1.57% | 0.20% | -0.05% | -0.12% |
| 过去三个月 | -0.40% | 0.17% | 2.08% | 0.19% | -2.48% | -0.02% |
| 过去六个月 | -0.30% | 0.16% | 3.70% | 0.17% | -4.00% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.10% | 0.15% | 3.62% | 0.19% | -3.52% | -0.04% |

创金合信鑫回报混合C

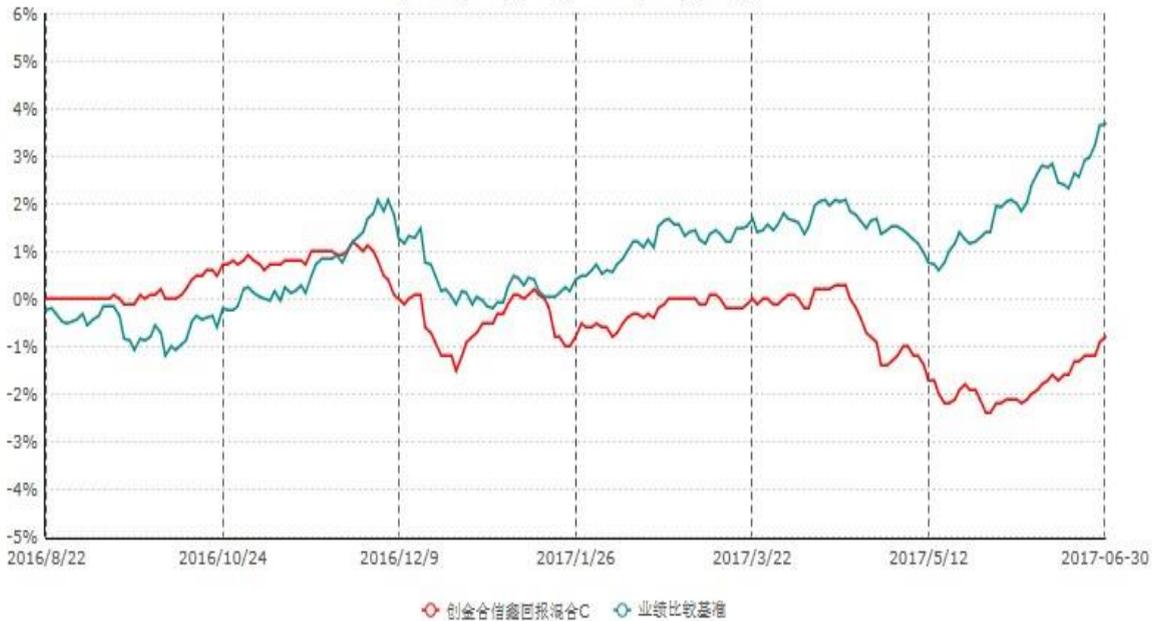
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 1.53% | 0.10% | 1.57% | 0.20% | -0.04% | -0.10% |
| 过去三个月 | -0.40% | 0.17% | 2.08% | 0.19% | -2.48% | -0.02% |
| 过去六个月 | -0.30% | 0.15% | 3.70% | 0.17% | -4.00% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.60% | 0.15% | 3.62% | 0.19% | -4.22% | -0.04% |

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

创金合鑫回报混合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08月22日-2017年06月30日)



创金合鑫回报混合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08月22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日正式注册设立，注册地为深圳市。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

报告期内，本公司共发行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 | 2016-08-22 | - | 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。 |
| 庞世恩 | 基金经理 | 2016-09-05 | - | 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。 |
| 蒋小玲 | 基金经理 | 2016-09-05 | - | 14年 | 蒋小玲女士，中国国籍，2002年9月-2009年12月任职于武进农村商业银行，2010年1月-2015年8月任职于江苏江南农村商业银行股份有限公司，历任金融市场部同业经理、交易员、投资经理等职务。2015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，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6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-0.30%，C类净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为3.70%。

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人-招商银行股份有限公司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》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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：创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

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 |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 5,037,359.39 | 7,501,057.65 |
| 结算备付金 | | 395,960.90 | 336,381.80 |
| 存出保证金 | | 23,372.97 | 22,215.16 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 540,613,751.85 | 512,832,279.32 |
| 其中：股票投资 | | 63,922,001.85 | 66,865,279.32 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 476,691,750.00 | 445,967,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 189,284.05 | 105,866.23 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 6,953,617.96 | 9,352,484.27 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 553,213,347.12 | 530,150,284.43 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017年06月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 54,609,678.08 | 29,999,715.00 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 99.76 | - |

| | | | |
|---------------|--------------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | | 243,251.34 | 253,423.70 |
| 应付托管费 | | 81,083.79 | 84,474.59 |
| 应付销售服务费 | | 15.26 | 31.39 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 204,888.42 | 207,564.72 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 21,365.60 | 29,097.06 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 88,341.54 | 74,000.00 |
| 负债合计 | | 55,248,723.79 | 30,648,306.46 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 497,337,637.67 | 497,661,150.16 |
| 未分配利润 | 6.4.7.1 0 | 626,985.66 | 1,840,827.81 |
| 所有者权益合计 | | 497,964,623.33 | 499,501,977.97 |
| 负债和所有者权益总计 | | 553,213,347.12 | 530,150,284.43 |

注:1. 报告截止日2017年6月30日, 基金份额总额497,337,637.67份, 其中下属A类基金份额497,253,144.09份, C类基金份额84,493.58份。下属A类基金份额净值1.001元, C类基金份额净值0.994元。

2. 本基金合同生效日为2016年8月22日, 无上年度可比期间。

6.2 利润表

会计主体: 创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

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 |
|-------------|----------|---------------------------|
| 一、收入 | | 2,206,564.79 |
| 1. 利息收入 | | 11,613,287.34 |
| 其中: 存款利息收入 | 6.4.7.11 | 50,987.92 |
| 债券利息收入 | | 11,492,795.75 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |

| | | |
|----------------------------|------------|---------------|
| 买入返售金融资产收入 | | 69,503.67 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -8,204,097.51 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -8,703,569.89 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -344,609.07 |
| 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 | 844,081.45 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -1,202,985.86 |
| 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 | 360.82 |
| 减：二、费用 | | 3,421,244.63 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,479,620.10 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 493,206.77 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 115.93 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 735,349.45 |
| 5. 利息支出 | | 610,616.66 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 610,616.66 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 102,335.72 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -1,214,679.84 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -1,214,679.84 |

注：本基金合同生效日为2016年8月22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：创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

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) | 497,661,150.16 | 1,840,827.81 | 499,501,977.97 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -1,214,679.84 | -1,214,679.84 |
| 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) | -323,512.49 | 837.69 | -322,674.80 |
| 其中：1. 基金申购款 | 7,507.52 | -27.58 | 7,479.94 |
| 2. 基金赎回款 | -331,020.01 | 865.27 | -330,154.74 |
| 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) | 497,337,637.67 | 626,985.66 | 497,964,623.33 |

注：本基金合同生效日为2016年8月22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

创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1644号《关于准予创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2016]1425号《关于创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币500,713,694.31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1108号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年8月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为500,781,246.31份基金份额,其中认购资金利息折合67,552.00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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围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、证券公司短期公司债、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:沪深300指数收益率 \times 30% + 一年期人民币定期存款利率(税后) \times 70%。

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 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 | 5,037,359.39 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限1-3个月 | - |
| 其他存款 | 0.00 |

| | |
|----|--------------|
| 合计 | 5,037,359.39 |
|----|--------------|

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 | 61,353,464.27 | 63,922,001.85 | 2,568,537.58 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 2,500,000.00 | 2,626,750.00 |
| | 银行间市场 | 491,010,717.29 | 474,065,000.00 |
| | 合计 | 493,510,717.29 | 476,691,750.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其他 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 554,864,181.56 | 540,613,751.85 | -14,250,429.71 |

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 | 1,665.32 |

| | |
|------------|--------------|
| 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 | 178.20 |
| 应收债券利息 | 6,951,763.94 |
| 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 | 10.50 |
| 合计 | 6,953,617.96 |

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 | 201,711.36 |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,177.06 |
| 合计 | 204,888.42 |

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 | 0.19 |
| 预提费用 | 88,341.35 |
| 合计 | 88,341.54 |

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 创金合信鑫回报混合A

金额单位：人民币元

| 项目 (创金合信鑫回报混合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 | 497,496,325.83 | 497,496,325.83 |
| 本期申购 | 1,996.64 | 1,996.64 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -245,178.38 | -245,178.38 |
| 本期末 | 497,253,144.09 | 497,253,144.09 |

6.4.7.9.2 创金合信鑫回报混合C

金额单位：人民币元

| 项目 (创金合信鑫回报混合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 | 164,824.33 | 164,824.33 |
| 本期申购 | 5,510.88 | 5,510.88 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -85,841.63 | -85,841.63 |
| 本期末 | 84,493.58 | 84,493.58 |

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 创金合信鑫回报混合A

单位：人民币元

| 项目 (创金合信鑫回报混合A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|--------------------|---------------|----------------|---------------|
| 上年度末 | 15,024,806.86 | -13,183,467.84 | 1,841,339.02 |
| 本期利润 | -11,804.06 | -1,202,580.22 | -1,214,384.28 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -8,336.73 | 8,902.31 | 565.58 |
| 其中：基金申购款 | 63.79 | -62.83 | 0.96 |
| 基金赎回款 | -8,400.52 | 8,965.14 | 564.62 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 15,004,666.07 | -14,377,145.75 | 627,520.32 |

6.4.7.10.2 创金合信鑫回报混合C

单位：人民币元

| 项目 (创金合信鑫回报混合 C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------------------------|-----------|-----------|---------|
| 上年度末 | 3,833.20 | -4,344.41 | -511.21 |
| 本期利润 | 110.08 | -405.64 | -295.56 |
| 本期基金份额交易产 生的变动数 | -2,049.97 | 2,322.08 | 272.11 |
| 其中：基金申购款 | 148.08 | -176.62 | -28.54 |
| 基金赎回款 | -2,198.05 | 2,498.70 | 300.65 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,893.31 | -2,427.97 | -534.66 |

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 | 46,257.19 |
| 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 | 4,518.86 |
| 其他 | 211.87 |
| 合计 | 50,987.92 |

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 | 272,143,844.42 |
| 减：卖出股票成本总额 | 280,847,414.31 |
| 买卖股票差价收入 | -8,703,569.89 |

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------------------------------|-------------------------|
| | 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 | -344,609.07 |
| 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 | -344,609.07 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------------------------|-------------------------|
| | 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 | 27,587,360.00 |
| 减：卖出债券(、债转股及 债券到期兑付)成本总额 | 26,344,609.07 |
| 减：应收利息总额 | 1,587,360.00 |
| 买卖债券差价收入 | -344,609.07 |

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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

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 | 844,081.45 |
| 基金投资产生的股利收益 | 0.00 |
| 合计 | 844,081.45 |

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 | -1,202,985.86 |
| ——股票投资 | 4,233,895.07 |
| ——债券投资 | -5,436,880.93 |
| ——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 | -1,202,985.86 |

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 | 360.82 |
| 合计 | 360.82 |

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 | 734,899.45 |
| 银行间市场交易费用 | 450.00 |
| 合计 | 735,349.45 |

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 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 49,588.57 |
| 查询服务费 | 600.00 |
| 汇划手续费 | 4,394.37 |
| 帐户维护费 | 18,000.00 |
| 合计 | 102,335.72 |

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 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人 |

| | |
|------------------------|----------|
| 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 |
| 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

| 关联方名称 | 本期 2017年01月01日至2017年06月30日 | |
|--------------|-------------------------------|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) |
| 第一创业证券股份有限公司 | 450,664,691.88 | 82.77 |

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于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

| 关联方名称 | 本期 2017年01月01日至2017年06月30日 | |
|--------------|-------------------------------|-------------------|
| | 债券回购成交金额 | 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 | 199,300,000.00 | 100.00 |

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

| 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 | 328,039.19 | 79.16 | 201,711.36 | 100.00 |

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。
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 |
|-----------------|-------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,479,620.10 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 435.84 |

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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,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 | 493,206.77 |

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。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 | | |
|----------------|-------------------------------|------------|------|
| | 创金合信鑫回报混合A | 创金合信鑫回报混合C | 合计 |
| 创金合信基金 | - | 9.74 | 9.74 |
| 合计 | - | 9.74 | 9.74 |

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0.2%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×0.2%/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 |
| 招商银行股份有限公司活期存款 | 5,037,359.39 | 46,257.19 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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 |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 603617 | 君禾股份 | 2017-06-23 | 2017-07-03 | 新发 流通 受限 | 8.93 | 8.93 | 832 | 7,429.76 | 7,429.76 | - |

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 |
|--------|------|------------|----------------|----------------|----------|----------------|---------|----------------|----------------|----------|
| 601088 | 中国神华 | 2017-06-05 | 重大 事项 停牌 | 22.29 | - | - | 181,200 | 3,847.15 | 4,038.94 | - |
| 60013 | 当代 | 2017- | 重大 | 16.79 | - | - | 22,30 | 369,1 | 374,4 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|----|-------|----------|--|--|--|---|-------|-------|--|
| 6 | 明诚 | 02-13 | 事项 停牌 | | | | 0 | 19.00 | 17.00 | |
|---|----|-------|----------|--|--|--|---|-------|-------|--|

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 54,609,678.08 元，是以如下债券作为抵押：

| 代码 | 名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量 | 期末估值总额 |
|---------|---------------|------------|--------|---------|-------------------|
| 1382243 | 13粤城建MT N1 | 2017-07-04 | 100.30 | 158,000 | 15,847,40 0.00 |
| 140915 | 17湖北03 | 2017-07-04 | 99.95 | 400,000 | 39,980,00 0.00 |
| 合计 | | | | 558,000 | 55,827,40 0.00 |

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招商银行，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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2017年06月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2017年06月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 336,804,750.00 | 298,633,000.00 |
| AAA以下 | 99,747,000.00 | 107,246,000.00 |
| 未评级 | 40,140,000.00 | 40,088,000.00 |
| 合计 | 476,691,750.00 | 445,967,000.00 |

注：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制的投资品种比例等。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 | 5,037,359.39 | - | - | - | 5,037,359.39 |
| 结算备付金 | 395,960.90 | - | - | - | 395,960.90 |
| 存出保证金 | 23,372.97 | - | - | - | 23,372.97 |

| | | | | | |
|---------------------|--------------------|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| 交易性金融资产 | 414,309,00 0.00 | 59,756,00 0.00 | 2,626,75 0.00 | 63,922,00 1.85 | 540,613,75 1.85 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 189,284.0 5 | 189,284.05 |
| 应收利息 | - | - | - | 6,953,61 7.96 | 6,953,617. 96 |
| 资产总计 | 419,765,69 3.26 | 59,756,00 0.00 | 2,626,75 0.00 | 71,064,90 3.86 | 553,213,34 7.12 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 54,609,67 8.08 | - | - | - | 54,609,67 8.08 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 99.76 | 99.76 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 243,251.3 4 | 243,251.34 |
| 应付托管费 | - | - | - | 81,083.79 | 81,083.79 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 15.26 | 15.26 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 204,888.4 2 | 204,888.42 |
| 应付利息 | - | - | - | 21,365.60 | 21,365.60 |
| 其他负债 | - | - | - | 88,341.54 | 88,341.54 |
| 负债总计 | 54,609,67 8.08 | - | - | 639,045.7 1 | 55,248,72 3.79 |
| 利率敏感度缺口 | 365,156,01 5.18 | 59,756,00 0.00 | 2,626,75 0.00 | 70,425,85 8.15 | 497,964,62 3.33 |
| 上年度末2016年1 2月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 7,501,057. 65 | - | - | - | 7,501,057. 65 |
| 结算备付金 | 336,381.80 | - | - | - | 336,381.80 |
| 存出保证金 | 22,215.16 | - | - | - | 22,215.16 |
| 交易性金融资产 | 60,286,00 | 385,681,00 | | 66,865,27 | 512,832,27 |

| | | | | | |
|-----------|---------------|----------------|---|---------------|----------------|
| | 0.00 | 0.00 | | 9.32 | 9.32 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 105,866.23 | 105,866.23 |
| 应收利息 | - | - | - | 9,352,484.27 | 9,352,484.27 |
| 资产总计 | 68,145,654.61 | 385,681,000.00 | - | 76,323,629.82 | 530,150,284.43 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 29,999,715.00 | - | - | - | 29,999,715.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 253,423.70 | 253,423.70 |
| 应付托管费 | - | - | - | 84,474.59 | 84,474.59 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 31.39 | 31.39 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 207,564.72 | 207,564.72 |
| 应付利息 | - | - | - | 29,097.06 | 29,097.06 |
| 其他负债 | - | - | - | 74,000.00 | 74,000.00 |
| 负债总计 | 29,999,715.00 | - | - | 648,591.46 | 30,648,306.46 |
| 利率敏感度缺口 | 38,145,939.61 | 385,681,000.00 | - | 75,675,038.36 | 499,501,977.97 |

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

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|---------------------|
| 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 |
| | 市场利率上升25个基点 | -1,962,636.00 | -2,142,662.39 |

| | | |
|-------------|--------------|--------------|
| 市场利率下降25个基点 | 1,978,004.42 | 2,160,919.16 |
|-------------|--------------|--------------|

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 | 63,922,001.85 | 12.84 | 66,865, | 13.39 |

| | | | | |
|---------------|---------------|-------|---------------|-------|
| | | | 279.32 | |
| 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 | 63,922,001.85 | 12.84 | 66,865,279.32 | 13.39 |

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 | 3,092,639.19 | - |
| | 比较基准下降5%资产净值变动 | -3,092,639.19 | - |

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62,085,813.06元，属于第二层次的余额为478,527,938.79元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次64,804,727.38元，第二层次448,027,551.94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 | 63,922,001.85 | 11.55 |
| | 其中:股票 | 63,922,001.85 | 11.55 |
| 2 | 固定收益投资 | 476,691,750.00 | 86.17 |
| | 其中:债券 | 476,691,750.00 | 86.17 |
| | 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 | 5,433,320.29 | 0.98 |
| 7 | 其他各项资产 | 7,166,274.98 | 1.30 |
| 8 | 合计 | 553,213,347.12 | 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 | 16,783,760.00 | 3.37 |
| C | 制造业 | 21,626,341.09 | 4.34 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 8,009,728.06 | 1.61 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,019,649.00 | 0.81 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,137,929.84 | 0.83 |
| J | 金融业 | 8,332,627.90 | 1.67 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 637,548.96 | 0.13 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 374,417.00 | 0.08 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 63,922,001.85 | 12.84 |

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 | 601225 | 陕西煤业 | 648,800 | 4,587,016.00 | 0.92 |
| 2 | 600893 | 航发动力 | 166,800 | 4,553,640.00 | 0.91 |
| 3 | 600585 | 海螺水泥 | 192,000 | 4,364,160.00 | 0.88 |
| 4 | 600019 | 宝钢股份 | 646,100 | 4,335,331.00 | 0.87 |
| 5 | 601899 | 紫金矿业 | 1,248,900 | 4,283,727.00 | 0.86 |
| 6 | 600061 | 国投安信 | 268,978 | 4,182,607.90 | 0.84 |
| 7 | 600999 | 招商证券 | 241,000 | 4,150,020.00 | 0.83 |
| 8 | 600637 | 东方明珠 | 190,952 | 4,137,929.84 | 0.83 |
| 9 | 600900 | 长江电力 | 266,600 | 4,100,308.00 | 0.82 |
| 10 | 600010 | 包钢股份 | 1,870,500 | 4,096,395.00 | 0.82 |
| 11 | 600104 | 上汽集团 | 130,200 | 4,042,710.00 | 0.81 |
| 12 | 601088 | 中国神华 | 181,200 | 4,038,948.00 | 0.81 |
| 13 | 601006 | 大秦铁路 | 479,100 | 4,019,649.00 | 0.81 |
| 14 | 600023 | 浙能电力 | 716,011 | 3,909,420.06 | 0.79 |
| 15 | 600028 | 中国石化 | 653,300 | 3,874,069.00 | 0.78 |
| 16 | 600093 | 易见股份 | 47,472 | 637,548.96 | 0.13 |
| 17 | 600136 | 当代明诚 | 22,300 | 374,417.00 | 0.08 |
| 18 | 603801 | 志邦股份 | 1,406 | 47,522.80 | 0.01 |
| 19 | 603043 | 广州酒家 | 1,810 | 45,738.70 | 0.01 |
| 20 | 603380 | 易德龙 | 1,298 | 35,370.50 | 0.01 |
| 21 | 603679 | 华体科技 | 809 | 21,438.50 | - |
| 22 | 603938 | 三孚股份 | 1,246 | 20,932.80 | - |
| 23 | 603933 | 睿能科技 | 857 | 17,311.40 | - |
| 24 | 603305 | 旭升股份 | 1,351 | 15,212.26 | - |
| 25 | 603286 | 日盈电子 | 890 | 13,528.00 | - |
| 26 | 603331 | 百达精工 | 999 | 9,620.37 | - |
| 27 | 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 | 600900 | 长江电力 | 4,091,395.00 | 0.82 |
| 2 | 601899 | 紫金矿业 | 4,091,272.00 | 0.82 |
| 3 | 600023 | 浙能电力 | 4,083,842.70 | 0.82 |
| 4 | 600061 | 国投安信 | 4,082,332.35 | 0.82 |
| 5 | 600019 | 宝钢股份 | 4,077,151.00 | 0.82 |
| 6 | 600999 | 招商证券 | 4,076,626.00 | 0.82 |
| 7 | 600028 | 中国石化 | 4,070,373.00 | 0.81 |
| 8 | 600104 | 上汽集团 | 4,070,339.04 | 0.81 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 4,059,469.00 | 0.81 |
| 10 | 600893 | 航发动力 | 4,051,681.00 | 0.81 |
| 11 | 600585 | 海螺水泥 | 4,041,073.00 | 0.81 |
| 12 | 601006 | 大秦铁路 | 4,034,258.55 | 0.81 |
| 13 | 600010 | 包钢股份 | 4,013,906.00 | 0.80 |
| 14 | 600637 | 东方明珠 | 3,982,453.80 | 0.80 |
| 15 | 601225 | 陕西煤业 | 3,926,926.00 | 0.79 |
| 16 | 601567 | 三星医疗 | 1,364,451.00 | 0.27 |
| 17 | 601313 | 江南嘉捷 | 1,350,131.96 | 0.27 |
| 18 | 603338 | 浙江鼎力 | 1,308,728.00 | 0.26 |
| 19 | 603808 | 歌力思 | 1,302,509.96 | 0.26 |
| 20 | 601799 | 星宇股份 | 1,294,576.00 | 0.26 |

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 | 601799 | 星宇股份 | 1,643,579.04 | 0.33 |
| 2 | 603808 | 歌力思 | 1,581,932.04 | 0.32 |
| 3 | 601567 | 三星医疗 | 1,576,508.18 | 0.32 |
| 4 | 600057 | 象屿股份 | 1,534,155.09 | 0.31 |
| 5 | 600874 | 创业环保 | 1,490,237.97 | 0.30 |
| 6 | 601313 | 江南嘉捷 | 1,475,620.66 | 0.30 |
| 7 | 603338 | 浙江鼎力 | 1,371,227.00 | 0.27 |
| 8 | 600345 | 长江通信 | 1,302,248.87 | 0.26 |
| 9 | 603518 | 维格娜丝 | 1,234,179.20 | 0.25 |
| 10 | 600513 | 联环药业 | 1,225,619.00 | 0.25 |
| 11 | 600218 | 全柴动力 | 1,200,802.00 | 0.24 |
| 12 | 600403 | *ST大有 | 1,185,263.00 | 0.24 |
| 13 | 603778 | 乾景园林 | 1,042,831.00 | 0.21 |
| 14 | 600328 | 兰太实业 | 1,019,343.00 | 0.20 |
| 15 | 600475 | 华光股份 | 1,009,467.76 | 0.20 |
| 16 | 601566 | 九牧王 | 988,710.00 | 0.20 |
| 17 | 600706 | 曲江文旅 | 977,197.00 | 0.20 |
| 18 | 600548 | 深高速 | 971,145.00 | 0.19 |
| 19 | 600510 | 黑牡丹 | 965,632.00 | 0.19 |
| 20 | 600162 | 香江控股 | 960,040.00 | 0.19 |

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 | 273,670,241.77 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 272,143,844.42 |

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|--------------|
|----|------|------|--------------|

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| 1 | 国家债券 | 39,980,000.00 | 8.03 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 69,978,000.00 | 14.05 |
| | 其中：政策性金融债 | 40,140,000.00 | 8.06 |
| 4 | 企业债券 | 18,417,000.00 | 3.70 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 345,690,000.00 | 69.42 |
| 7 | 可转债 | 2,626,750.00 | 0.53 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 476,691,750.00 | 95.73 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 101460001 | 14闽电信MTN001 | 400,000 | 41,384,000.00 | 8.31 |
| 2 | 101575004 | 15金融街MTN002 | 400,000 | 40,516,000.00 | 8.14 |
| 3 | 1382243 | 13粤城建MTN1 | 400,000 | 40,120,000.00 | 8.06 |
| 4 | 140915 | 17湖北03 | 400,000 | 39,980,000.00 | 8.03 |
| 5 | 101465008 | 14苏交通MTN001 | 300,000 | 30,702,000.00 | 6.17 |

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

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 | 23,372.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | 189,284.05 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,953,617.96 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 0.00 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,166,274.98 |

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

注:本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|------------|----------|--------------|----------------|-----------|------------|-----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例(%) | 持有份额 | 占总份额比例(%) |
| 创金合信鑫回报混合A | 167 | 2,977,563.74 | 497,212,925.04 | 99.99 | 40,219.05 | 0.01 |
| 创金合信鑫回报混合C | 51 | 1,656.74 | - | - | 84,493.58 | 100.00 |
| 合计 | 213 | 2,334,918.49 | 497,212,925.04 | 99.97 | 124,712.63 | 0.03 |

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 | 创金合信鑫回报混合A | 26,255.33 | 0.01 |
| | 创金合信鑫回报混合C | 1,900.23 | 2.25 |

| | | | |
|--|----|-----------|------|
| | 合计 | 28,155.56 | 0.01 |
|--|----|-----------|------|

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 | 创金合信鑫回报混合A | 0~10 |
| | 创金合信鑫回报混合C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 创金合信鑫回报混合A | 0~10 |
| | 创金合信鑫回报混合C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 创金合信鑫回报混合A | 创金合信鑫回报混合C |
|----------------------------|----------------|------------|
| 基金合同生效日(2016年08月22日)基金份额总额 | 500,349,524.01 | 431,722.30 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 497,496,325.83 | 164,824.33 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 1,996.64 | 5,510.88 |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额 | 245,178.38 | 85,841.63 |
| 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 | 497,253,144.09 | 84,493.58 |

§ 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 (%) | |
| 光大证券 | 2 | 93,808,612.44 | 17.23 | 86,356.05 | 20.84 | - |
| 第一创业证券 | 2 | 450,664,691.88 | 82.77 | 328,039.19 | 79.16 | - |

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。

本基金报告期内无租用券商交易单元的变更情况。

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 (%) |
| 光大证券 | - | - | - | 0.00 | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | - | - | 199,300,000.00 | 100.00 | - | - | - | - |

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、中国证券报 | 2017-01-01 |
| 2 | 创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2016年第4季度报告 | 公司官网、中国证券报 | 2017-01-23 |
| 3 | 创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告 | 公司官网、中国证券报 | 2017-03-27 |
| 4 | 创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2016年年 | 公司官网、中国证券报 | 2017-03-27 |

| | | | |
|---|---|------------|------------|
| | 度报告-摘要 | | |
| 5 | 创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金（2017年第1号）招募说明书（更新） | 公司官网、中国证券报 | 2017-04-08 |
| 6 | 创金合信鑫回报灵活配置混合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、中国证券报 | 2017-04-08 |
| 7 | 创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告 | 公司官网、中国证券报 | 2017-04-21 |
| 8 | 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、中国证券报 | 2017-04-26 |
| 9 | 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、中国证券报 | 2017-06-23 |

§ 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 | 20170101-20170630 | 497,212,925.04 | 0.00 | 0.00 | 497,212,925.04 | 99.97 |
| 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、《创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金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

创金合信基金管理有限公司
二〇一七年八月二十五日