

创金合信量化核心混合型证券投资基金

2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 31 日

§ 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 2018 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 03 月 27 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信量化核心混合	
基金主代码	004359	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年03月27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	134,987,531.05份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信量化核心混合A	创金合信量化核心混合C
下属分级基金的交易代码	004359	004360
报告期末下属分级基金的份额总额	76,565,435.10份	58,422,095.95份

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	沪深300指数收益率×80%+中债综合财富（总值）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		创金合信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	本期2017年03月27日（基金合同生效日）-2017年12月31日	
	创金合信量化核心混合A	创金合信量化核心混合C
本期已实现收益	23,455,770.37	16,421,110.58
本期利润	22,069,074.07	20,656,477.60
加权平均基金份额本期利润	0.1143	0.0793
本期基金份额净值增长率	12.36%	11.46%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	
期末可供分配基金份额利润	0.1236	0.1146
期末基金资产净值	86,032,024.29	65,115,536.51
期末基金份额净值	1.1236	1.1146

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. 本基金合同生效日为2017年3月27日，截至报告期末，本基金成立不满一年。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信量化核心混合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
过去三个月	5.28%	0.65%	3.98%	0.64%	1.30%	0.01%
过去六个月	9.52%	0.59%	8.00%	0.56%	1.52%	0.03%
自基金合同生效起至今	12.36%	0.53%	12.46%	0.54%	-0.10%	-0.01%

创金合信量化核心混合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
过去三个月	5.02%	0.65%	3.98%	0.64%	1.04%	0.01%
过去六个月	8.90%	0.59%	8.00%	0.56%	0.90%	0.03%
自基金合同生效起至今	11.46%	0.53%	12.46%	0.54%	-1.00%	-0.01%

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

创金合信量化核心混合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

(2017年03月27日-2017年12月31日)



创金合信量化核心混合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

(2017年03月27日-2017年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2017年3月27日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

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

报告期内，本公司共发行8只公募基金。截至2017年12月31日，本公司共管理29只公募基金，其中混合型产品11只、指数型产品4只、债券型产品8只、股票型产品4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149.41亿元。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程志田	本基金经理、量化投资部总监	2017-03-27	-	11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。
谢东旭	本基金经理	2017-09-11	-	6年	谢东旭先生，中国国籍，复旦大学硕士。曾在中信证券股份有限公司从事研究工作。2012年2月加入华安基金管理有限

					公司后从事量化分析与投资工作。2013年11月起担任华安沪深300量化增强证券投资基金的基金经理助理，2015年1月21日至2017年1月26日担任华安沪深300量化增强证券投资基金基金经理。2017年5月加入创金合信基金，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日期；

2、证券从业年限的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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。本基金的投资范围、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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、

投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，监察稽核部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如1日内、3日、5日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2017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

截至报告期末创金合信量化核心混合A基金份额净值为1.1236元；本报告期内，基金份额净值增长率为12.36%，同期业绩比较基准收益率为12.46%；截至报告期末创金合信量化核心混合C基金份额净值为1.1146元；本报告期内，基金份额净值增长率为11.46%，同期业绩比较基准收益率为12.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观上看，经济基本面韧性较强，全年增长率超预期。考虑到在房地产政策趋紧的情况下，房地产成交量萎缩，投资房市的资金需要重新配置，在海外投资受限的情况下，权益类资产有望在投资者投资配置中提升权重。从投资情绪来看，市场已在一定程度上回暖，投资者风险偏好提升，爆款基金密集发行，增量资金入市情况明显。

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、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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

本基金本报告期内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核心混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，创金合信量化核心混合型证券投资基金的管理人——创金合信基金管理有限公司在创金合信量化核心混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本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核心混合型证券投资基金2017年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 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2017年12月31日的资产负债表、2017年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017年12月31日
资 产：	
银行存款	14,698,850.67
结算备付金	7,684,132.38
存出保证金	1,988,235.80
交易性金融资产	127,818,204.96
其中：股票投资	127,356,171.56
基金投资	-
债券投资	462,033.40

资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	288,064.90
应收利息	7,926.18
应收股利	-
应收申购款	104,869.38
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	152,590,284.27
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	673,684.29
应付管理人报酬	206,259.95
应付托管费	34,376.65
应付销售服务费	45,300.56
应付交易费用	309,089.42
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	174,012.60
负债合计	1,442,723.47
所有者权益:	

实收基金	134,987,531.05
未分配利润	16,160,029.75
所有者权益合计	151,147,560.80
负债和所有者权益总计	152,590,284.27

注：1. 报告截止日2017年12月31日，基金份额总额134,987,531.05份，其中下属A类基金份额76,565,435.10份，C类基金份额58,422,095.95份。下属A类基金份额净值1.1236元，C类基金份额净值1.1146元。

2. 本基金合同生效日为2017年3月27日，2017年年度实际报告期间为2017年3月27日至2017年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满1年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

本报告期：2017年03月27日（基金合同生效日）至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期2017年03月27日（基金合同生效日）至2017年12月31日
一、收入	57,302,802.12
1. 利息收入	3,132,802.73
其中：存款利息收入	659,758.76
债券利息收入	329,218.52
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,143,825.45
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	50,941,830.16
其中：股票投资收益	44,721,980.06
基金投资收益	-
债券投资收益	102,464.56
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-2,660,820.00

股利收益	8,778,205.54
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	2,848,670.72
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	379,498.51
减：二、费用	14,577,250.45
1. 管理人报酬	5,325,359.78
2. 托管费	887,560.04
3. 销售服务费	1,619,995.73
4. 交易费用	6,556,762.71
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	187,572.19
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	42,725,551.67
减：所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	42,725,551.67

注：本财务报表的实际编制期间为2017年3月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满1年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

本报告期：2017年03月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年03月27日(基金合同生效日)至2017年12月31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)	801,997,731.79	-	801,997,731.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	42,725,551.67	42,725,551.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	-667,010,200.74	-26,565,521.92	-693,575,722.66

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	55,715,216.87	2,131,409.39	57,846,626.26
2. 基金赎回款	-722,725,417.61	-28,696,931.31	-751,422,348.92
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）	134,987,531.05	16,160,029.75	151,147,560.80

注：本财务报表的实际报告期间为2017年3月27日（基金合同生效日）至2017年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满1年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

创金合信量化核心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[2017]5号《关于准予创金合信量化核心混合型证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信量化核心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801,695,744.90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（2017）第116号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为801,997,731.79份基金份额，其中认购资金利息折合301,986.89份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信量化核心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、次级债、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 80%+中债综合财富(总值)指数收益率 \times 20%。

7.4.2 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》、《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2017年1月23日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分

类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(4) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；(5) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致后，可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会

关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 关联方关系

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

关联方名称	与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年03月27日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,325,359.78
其中：支付销售机构的客户维护费	3,361,276.07

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年03月27日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	887,560.04

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

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各	本期

关联方名称	2017年03月27日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金合信量化核心混 合A	创金合信量化核心混 合C	合计
中国工商银行	-	1,070,261.96	1,070,261.96
创金合信直销	-	82,784.80	82,784.80
第一创业	-	5,569.38	5,569.38
合计	-	1,158,616.14	1,158,616.14

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0.8%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× 0.8%/ 当年天数。

7.4.8.3 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的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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03月27日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	14,698,850.67	400,231.86

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新发流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新发流通受限	16.75	16.75	1,239	20,755.25	20,753.25	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新发流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	新发流通受限	11.06	53.21	405	4,479.30	21,550.05	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
128024	宁行转债	2017-12-05	2018-01-12	新发流通受限	100.00	100.00	321	32,100.00	32,100.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开盘	数量(股)	期末成本	期末估值	备注

				单价		单价		总额	总额	
600309	万华化学	2017-12-05	重大事项停牌	37.94	-	-	68,600	2,656.906	2,602.684.00	-
002470	金正大	2017-10-25	重大事项停牌	9.15	2018-02-09	8.24	159,600	1,321.504.71	1,460.340.00	-
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项停牌	11.40	-	-	69,900	941,609.03	796,860.00	-
000031	中粮地产	2017-07-24	重大事项停牌	8.00	-	-	82,900	626,333.42	663,200.00	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项停牌	17.40	-	-	18,400	319,879.45	320,160.00	-
002358	森源电气	2017-12-07	重大事项停牌	14.86	2018-03-07	15.05	19,300	295,540.14	286,798.00	-
601216	君正集团	2017-12-15	重大事项停牌	4.71	-	-	51,700	257,108.70	243,507.00	-
600332	白云山	2017-10-31	重大事项停牌	32.14	2018-01-08	30.15	3,201	88,341.02	102,880.14	-
300010	立思辰	2017-11-17	重大事项停牌	11.17	2018-02-22	10.05	6,500	76,448.00	72,605.00	-
002345	潮宏基	2017-12-20	重大事项停牌	10.75	-	-	6,400	68,651.29	68,800.00	-
300730	科创信息	2017-12-	重大事项	41.55	2018-01-	45.71	821	6,863.56	34,112.5	-

		25	停牌		02				5	
0029 19	名臣 健康	2017 -12- 28	重大 事项 停牌	35.2 6	2018 -01- 02	38.7 9	821	10,3 11.7 6	28,9 48.4 6	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31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。

7.4.10 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12月31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120,584,506.71 元，属于第二层次的余额为7,233,698.25 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。

(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12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	127,356,171.56	83.46
	其中：股票	127,356,171.56	83.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	462,033.40	0.30
	其中：债券	462,033.40	0.30
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	22,382,983.05	14.67
8	其他各项资产	2,389,096.26	1.57
9	合计	152,590,284.27	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	98,235.00	0.06
B	采矿业	5,129,158.38	3.39
C	制造业	53,741,924.19	35.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,905,742.20	1.26
E	建筑业	4,521,158.00	2.99
F	批发和零售业	2,763,345.00	1.83
G	交通运输、仓储和邮政业	5,348,271.76	3.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,269,659.55	2.82
J	金融业	36,453,161.53	24.12
K	房地产业	6,682,123.00	4.42
L	租赁和商务服务业	2,176,410.00	1.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,629,403.95	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	590,490.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	2,016,723.00	1.33
S	综合	30,366.00	0.02
	合计	127,356,171.56	84.26

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	601628	中国人寿	166,693	5,075,801.85	3.36
2	601318	中国平安	60,806	4,255,203.88	2.82
3	000333	美的集团	75,100	4,162,793.00	2.75
4	000002	万科A	106,200	3,298,572.00	2.18
5	600036	招商银行	110,800	3,215,416.00	2.13
6	000725	京东方A	507,300	2,937,267.00	1.94
7	601006	大秦铁路	319,100	2,894,237.00	1.91
8	600309	万华化学	68,600	2,602,684.00	1.72
9	600519	贵州茅台	3,600	2,510,964.00	1.66
10	002304	洋河股份	20,900	2,403,500.00	1.59

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.cjxfund.com网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	100,702,901.37	66.63
2	601668	中国建筑	81,219,237.72	53.74
3	601628	中国人寿	74,701,482.17	49.42
4	600519	贵州茅台	73,545,874.93	48.66
5	600104	上汽集团	69,476,932.29	45.97

6	000651	格力电器	63,768,001.56	42.19
7	600030	中信证券	63,412,312.04	41.95
8	000725	京东方 A	62,772,796.00	41.53
9	601006	大秦铁路	53,415,242.47	35.34
10	000776	广发证券	50,757,828.11	33.58
11	000069	华侨城 A	43,149,578.02	28.55
12	000858	五 粮 液	42,013,929.90	27.80
13	600585	海螺水泥	40,237,028.04	26.62
14	600016	民生银行	40,225,666.80	26.61
15	600036	招商银行	40,071,199.43	26.51
16	601166	兴业银行	39,197,269.00	25.93
17	000425	徐工机械	38,784,842.00	25.66
18	601328	交通银行	36,158,194.00	23.92
19	600637	东方明珠	33,502,083.44	22.17
20	601088	中国神华	33,457,483.86	22.14
21	600028	中国石化	30,956,043.19	20.48
22	000157	中联重科	30,747,655.70	20.34
23	000002	万 科 A	29,869,131.59	19.76
24	000063	中兴通讯	29,741,293.53	19.68
25	000060	中金岭南	28,774,363.76	19.04
26	601288	农业银行	28,681,274.00	18.98
27	601186	中国铁建	28,138,446.67	18.62
28	600023	浙能电力	27,855,828.00	18.43
29	601211	国泰君安	27,657,491.40	18.30
30	600837	海通证券	26,748,131.34	17.70
31	600000	浦发银行	26,667,701.75	17.64
32	600999	招商证券	26,099,779.22	17.27
33	600900	长江电力	26,035,711.38	17.23
34	000333	美的集团	25,278,758.82	16.72
35	600309	万华化学	24,854,321.20	16.44
36	000685	中山公用	24,296,500.24	16.07

37	000402	金融街	23,938,044.23	15.84
38	601607	上海医药	23,565,228.14	15.59
39	601169	北京银行	22,835,584.15	15.11
40	601225	陕西煤业	22,609,731.42	14.96
41	002304	洋河股份	22,461,152.69	14.86
42	002152	广电运通	21,600,177.46	14.29
43	002202	金风科技	21,158,803.64	14.00
44	601899	紫金矿业	20,890,239.00	13.82
45	002736	国信证券	20,753,787.20	13.73
46	600019	宝钢股份	20,639,956.20	13.66
47	600048	保利地产	20,255,654.99	13.40
48	000895	双汇发展	20,251,827.50	13.40
49	601988	中国银行	19,882,798.00	13.15
50	000028	国药一致	19,631,867.48	12.99
51	601390	中国中铁	18,571,621.00	12.29
52	002470	金正大	18,482,889.00	12.23
53	601800	中国交建	18,119,798.00	11.99
54	601857	中国石油	18,029,159.55	11.93
55	002092	中泰化学	17,879,043.00	11.83
56	000938	紫光股份	17,726,513.15	11.73
57	300026	红日药业	17,378,350.74	11.50
58	000078	海王生物	17,245,809.77	11.41
59	000738	航发控制	17,092,009.24	11.31
60	000686	东北证券	16,881,223.80	11.17
61	000623	吉林敖东	16,863,833.00	11.16
62	000783	长江证券	16,731,352.00	11.07
63	002244	滨江集团	16,349,950.40	10.82
64	000001	平安银行	15,598,074.80	10.32
65	601377	兴业证券	15,455,841.80	10.23
66	002146	荣盛发展	15,055,517.24	9.96
67	002093	国脉科技	15,013,188.30	9.93

68	002001	新 和 成	14,941,547.00	9.89
69	000999	华润三九	14,551,897.56	9.63
70	600208	新湖中宝	14,304,217.26	9.46
71	000750	国海证券	14,192,391.50	9.39
72	601555	东吴证券	14,041,098.10	9.29
73	002004	华邦健康	13,974,121.00	9.25
74	000598	兴蓉环境	13,737,499.56	9.09
75	000501	鄂武商 A	13,427,888.81	8.88
76	000156	华数传媒	13,140,795.39	8.69
77	601818	光大银行	13,067,554.00	8.65
78	600015	华夏银行	12,778,286.71	8.45
79	600862	中航高科	12,333,834.45	8.16
80	600739	辽宁成大	11,941,336.00	7.90
81	000400	许继电气	11,912,003.00	7.88
82	002396	星网锐捷	11,833,168.23	7.83
83	002500	山西证券	11,718,174.62	7.75
84	002081	金 螳 螂	11,696,542.76	7.74
85	600061	国投资本	11,404,602.00	7.55
86	002602	世纪华通	11,061,894.20	7.32
87	000625	长安汽车	10,937,798.00	7.24
88	002646	青青稞酒	10,842,229.29	7.17
89	000830	鲁西化工	10,722,569.00	7.09
90	000793	华闻传媒	10,680,905.00	7.07
91	000166	申万宏源	10,436,414.00	6.90
92	000517	荣安地产	10,263,345.00	6.79
93	002019	亿帆医药	10,157,328.86	6.72
94	002024	苏宁云商	9,929,793.00	6.57
95	601688	华泰证券	9,894,250.40	6.55
96	600362	江西铜业	9,880,591.54	6.54
97	000960	锡业股份	9,872,446.80	6.53
98	601009	南京银行	9,862,241.20	6.52

99	000568	泸州老窖	9,805,271.00	6.49
100	300024	机器人	9,440,634.61	6.25
101	002013	中航机电	9,347,277.61	6.18
102	601939	建设银行	9,335,186.60	6.18
103	000825	太钢不锈	8,936,104.00	5.91
104	600741	华域汽车	8,847,479.18	5.85
105	002179	中航光电	8,546,834.93	5.65
106	600705	中航资本	8,502,592.98	5.63
107	002479	富春环保	8,376,191.00	5.54
108	600089	特变电工	8,344,980.30	5.52
109	600703	三安光电	8,240,784.39	5.45
110	000338	潍柴动力	8,235,035.00	5.45
111	000547	航天发展	8,216,824.00	5.44
112	000709	河钢股份	8,210,880.00	5.43
113	000415	渤海金控	8,035,408.00	5.32
114	002027	分众传媒	8,016,415.96	5.30
115	002142	宁波银行	7,853,742.74	5.20
116	600958	东方证券	7,818,725.98	5.17
117	000959	首钢股份	7,618,072.87	5.04
118	002065	东华软件	7,596,735.49	5.03
119	600674	川投能源	7,443,942.00	4.92
120	600893	航发动力	7,376,329.87	4.88
121	600570	恒生电子	7,341,040.00	4.86
122	601919	中远海控	7,337,356.27	4.85
123	600219	南山铝业	7,241,567.00	4.79
124	000417	合肥百货	7,165,383.01	4.74
125	601928	凤凰传媒	7,130,266.00	4.72
126	600690	青岛海尔	7,021,076.00	4.65
127	600031	三一重工	6,925,685.04	4.58
128	600332	白云山	6,412,851.63	4.24
129	601601	中国太保	6,407,791.71	4.24

130	601898	中煤能源	6,183,310.39	4.09
131	000596	古井贡酒	6,125,691.00	4.05
132	600839	四川长虹	6,091,220.91	4.03
133	601788	光大证券	6,078,303.03	4.02
134	600256	广汇能源	5,962,736.00	3.94
135	601336	新华保险	5,942,170.00	3.93
136	000792	盐湖股份	5,926,601.00	3.92
137	002475	立讯精密	5,862,236.50	3.88
138	603000	人民网	5,765,019.24	3.81
139	601998	中信银行	5,750,307.00	3.80
140	600340	华夏幸福	5,644,959.00	3.73
141	002281	光迅科技	5,601,679.00	3.71
142	600018	上港集团	5,554,433.00	3.67
143	601012	隆基股份	5,546,491.54	3.67
144	002008	大族激光	5,514,951.00	3.65
145	002195	二三四五	5,344,412.00	3.54
146	000538	云南白药	5,289,708.00	3.50
147	002078	太阳纸业	5,261,266.00	3.48
148	600188	兖州煤业	5,246,285.00	3.47
149	002252	上海莱士	5,166,369.43	3.42
150	002570	贝因美	5,118,146.00	3.39
151	600010	包钢股份	4,974,060.36	3.29
152	000061	农产品	4,843,022.90	3.20
153	000671	阳光城	4,829,965.00	3.20
154	002463	沪电股份	4,793,506.87	3.17
155	000027	深圳能源	4,704,035.26	3.11
156	000039	中集集团	4,695,117.96	3.11
157	600009	上海机场	4,597,499.56	3.04
158	000983	西山煤电	4,591,853.69	3.04
159	001979	招商蛇口	4,446,730.40	2.94
160	600300	维维股份	4,437,060.99	2.94

161	601600	中国铝业	4,434,772.00	2.93
162	600879	航天电子	4,419,629.68	2.92
163	300133	华策影视	4,339,868.70	2.87
164	600380	健康元	4,332,823.00	2.87
165	300324	旋极信息	4,327,427.21	2.86
166	600060	海信电器	4,310,104.00	2.85
167	000021	深科技	4,305,980.00	2.85
168	600056	中国医药	4,283,490.00	2.83
169	002310	东方园林	4,262,228.80	2.82
170	000046	泛海控股	4,216,582.00	2.79
171	600373	中文传媒	4,078,804.00	2.70
172	002405	四维图新	4,037,015.00	2.67
173	000581	威孚高科	3,990,189.63	2.64
174	300136	信维通信	3,928,151.87	2.60
175	002241	歌尔股份	3,861,687.00	2.55
176	300274	阳光电源	3,817,296.00	2.53
177	000050	深天马 A	3,791,571.69	2.51
178	600919	江苏银行	3,771,337.00	2.50
179	000997	新大陆	3,742,429.15	2.48
180	600549	厦门钨业	3,712,993.40	2.46
181	002482	广田集团	3,682,163.00	2.44
182	600369	西南证券	3,682,122.00	2.44
183	300072	三聚环保	3,649,337.00	2.41
184	601258	庞大集团	3,620,800.00	2.40
185	600111	北方稀土	3,616,762.00	2.39
186	000639	西王食品	3,569,783.00	2.36
187	601231	环旭电子	3,533,176.86	2.34
188	002002	鸿达兴业	3,467,844.00	2.29
189	002450	康得新	3,429,657.00	2.27
190	002568	百润股份	3,422,181.00	2.26
191	601766	中国中车	3,416,130.00	2.26

192	002437	誉衡药业	3,391,703.00	2.24
193	600161	天坛生物	3,373,769.00	2.23
194	300199	翰宇药业	3,326,727.00	2.20
195	300257	开山股份	3,308,284.95	2.19
196	600153	建发股份	3,302,297.00	2.18
197	601111	中国国航	3,267,382.00	2.16
198	002236	大华股份	3,263,851.00	2.16
199	600518	康美药业	3,253,651.00	2.15
200	600233	圆通速递	3,220,277.98	2.13
201	000963	华东医药	3,209,452.00	2.12
202	600666	奥瑞德	3,178,387.00	2.10
203	600406	国电南瑞	3,135,308.00	2.07
204	300168	万达信息	3,093,350.78	2.05
205	002422	科伦药业	3,038,503.92	2.01
206	002416	爱施德	3,034,927.27	2.01

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	101,595,520.01	67.22
2	601668	中国建筑	80,348,164.52	53.16
3	600519	贵州茅台	72,664,028.25	48.07
4	601628	中国人寿	70,006,698.19	46.32
5	600104	上汽集团	69,852,805.44	46.21
6	000651	格力电器	66,252,952.39	43.83
7	600030	中信证券	63,952,790.65	42.31
8	000725	京东方A	62,795,161.00	41.55
9	601006	大秦铁路	51,844,806.32	34.30
10	000776	广发证券	50,432,088.16	33.37
11	000858	五粮液	44,377,411.31	29.36

12	000069	华侨城 A	42,792,526.75	28.31
13	600585	海螺水泥	41,035,779.02	27.15
14	600036	招商银行	39,436,011.27	26.09
15	000425	徐工机械	38,488,570.00	25.46
16	600016	民生银行	38,335,026.27	25.36
17	601166	兴业银行	37,020,594.40	24.49
18	601328	交通银行	34,953,085.99	23.13
19	600637	东方明珠	33,298,600.88	22.03
20	601088	中国神华	32,884,884.52	21.76
21	000157	中联重科	30,694,893.65	20.31
22	600028	中国石化	30,609,798.12	20.25
23	000063	中兴通讯	30,100,336.19	19.91
24	000060	中金岭南	28,413,289.88	18.80
25	601288	农业银行	27,818,107.00	18.40
26	600023	浙能电力	27,622,647.04	18.28
27	601211	国泰君安	27,111,101.00	17.94
28	601186	中国铁建	26,782,710.95	17.72
29	000002	万科 A	26,636,594.12	17.62
30	600999	招商证券	25,964,539.84	17.18
31	600900	长江电力	25,961,334.35	17.18
32	600000	浦发银行	25,315,998.69	16.75
33	000685	中山公用	24,555,365.17	16.25
34	000402	金融街	23,967,032.12	15.86
35	600837	海通证券	23,723,658.98	15.70
36	601225	陕西煤业	23,439,143.04	15.51
37	000333	美的集团	22,654,771.97	14.99
38	601607	上海医药	22,411,737.09	14.83
39	600309	万华化学	22,333,029.75	14.78
40	002152	广电运通	21,408,785.45	14.16
41	002202	金风科技	21,027,208.85	13.91
42	601899	紫金矿业	20,978,120.50	13.88

43	002736	国信证券	20,631,785.00	13.65
44	601169	北京银行	20,597,751.20	13.63
45	002304	洋河股份	20,580,587.89	13.62
46	600019	宝钢股份	20,543,429.42	13.59
47	000028	国药一致	20,375,979.86	13.48
48	600048	保利地产	20,277,870.84	13.42
49	000895	双汇发展	19,294,038.00	12.77
50	601988	中国银行	19,254,057.70	12.74
51	000938	紫光股份	18,869,704.59	12.48
52	601390	中国中铁	18,751,826.00	12.41
53	002092	中泰化学	17,841,046.00	11.80
54	002470	金正大	17,635,805.74	11.67
55	000078	海王生物	17,401,548.66	11.51
56	000738	航发控制	17,071,181.98	11.29
57	300026	红日药业	17,002,638.35	11.25
58	601800	中国交建	16,866,064.18	11.16
59	000623	吉林敖东	16,774,660.69	11.10
60	601857	中国石油	16,594,424.00	10.98
61	002244	滨江集团	16,539,563.40	10.94
62	002001	新和成	16,043,968.08	10.61
63	601377	兴业证券	15,836,227.36	10.48
64	000783	长江证券	15,318,543.00	10.13
65	000686	东北证券	15,038,568.22	9.95
66	002093	国脉科技	14,954,192.93	9.89
67	000001	平安银行	14,935,726.13	9.88
68	002146	荣盛发展	14,929,631.00	9.88
69	000999	华润三九	14,445,380.05	9.56
70	601555	东吴证券	14,437,120.00	9.55
71	600208	新湖中宝	14,187,373.75	9.39
72	000598	兴蓉环境	13,836,629.00	9.15
73	002004	华邦健康	13,705,281.00	9.07

74	000750	国海证券	13,635,590.00	9.02
75	000501	鄂武商 A	13,273,273.89	8.78
76	601818	光大银行	12,644,240.00	8.37
77	600862	中航高科	12,353,958.42	8.17
78	600015	华夏银行	12,213,048.80	8.08
79	002396	星网锐捷	12,125,658.16	8.02
80	000156	华数传媒	12,080,397.41	7.99
81	600739	辽宁成大	12,063,151.55	7.98
82	000830	鲁西化工	11,959,436.95	7.91
83	002081	金螳螂	11,816,338.21	7.82
84	000400	许继电气	11,646,465.00	7.71
85	002500	山西证券	11,536,711.39	7.63
86	600061	国投资本	11,208,124.00	7.42
87	002602	世纪华通	11,087,119.39	7.34
88	002646	青青稞酒	10,762,181.70	7.12
89	000793	华闻传媒	10,680,431.00	7.07
90	000166	申万宏源	10,513,307.40	6.96
91	000625	长安汽车	10,277,356.05	6.80
92	000517	荣安地产	10,259,749.00	6.79
93	002019	亿帆医药	10,224,840.56	6.76
94	000960	锡业股份	9,858,663.60	6.52
95	601688	华泰证券	9,725,314.00	6.43
96	600362	江西铜业	9,725,211.94	6.43
97	601009	南京银行	9,452,531.00	6.25
98	002024	苏宁云商	9,440,490.00	6.25
99	601939	建设银行	9,219,244.74	6.10
100	300024	机器人	9,000,362.90	5.95
101	000825	太钢不锈	8,986,815.00	5.95
102	000568	泸州老窖	8,885,642.57	5.88
103	000547	航天发展	8,797,731.51	5.82
104	002179	中航光电	8,662,992.20	5.73

105	002013	中航机电	8,578,413.00	5.68
106	600703	三安光电	8,502,846.85	5.63
107	600741	华域汽车	8,490,912.07	5.62
108	600089	特变电工	8,473,229.10	5.61
109	000709	河钢股份	8,378,402.32	5.54
110	002479	富春环保	8,244,281.90	5.45
111	000415	渤海金控	7,995,025.40	5.29
112	600705	中航资本	7,767,637.12	5.14
113	600958	东方证券	7,670,721.30	5.07
114	600219	南山铝业	7,567,640.75	5.01
115	002142	宁波银行	7,507,075.00	4.97
116	600674	川投能源	7,403,167.61	4.90
117	600893	航发动力	7,361,708.40	4.87
118	000959	首钢股份	7,347,341.00	4.86
119	600690	青岛海尔	7,341,394.00	4.86
120	000417	合肥百货	7,236,501.34	4.79
121	000338	潍柴动力	7,169,166.47	4.74
122	002065	东华软件	7,024,249.45	4.65
123	600570	恒生电子	6,997,319.64	4.63
124	601928	凤凰传媒	6,986,803.00	4.62
125	600031	三一重工	6,917,868.13	4.58
126	601919	中远海控	6,756,776.00	4.47
127	002027	分众传媒	6,606,601.40	4.37
128	000596	古井贡酒	6,403,977.56	4.24
129	600332	白云山	6,401,948.26	4.24
130	601601	中国太保	6,231,483.90	4.12
131	601012	隆基股份	6,102,331.00	4.04
132	601336	新华保险	5,961,361.73	3.94
133	601788	光大证券	5,929,640.16	3.92
134	601898	中煤能源	5,877,068.76	3.89
135	600256	广汇能源	5,748,420.00	3.80

136	002475	立讯精密	5,739,658.33	3.80
137	600839	四川长虹	5,727,376.00	3.79
138	002078	太阳纸业	5,682,196.00	3.76
139	601998	中信银行	5,460,935.00	3.61
140	002008	大族激光	5,443,862.00	3.60
141	002281	光迅科技	5,437,530.60	3.60
142	600340	华夏幸福	5,357,481.54	3.54
143	603000	人民网	5,354,524.14	3.54
144	000792	盐湖股份	5,337,538.00	3.53
145	002570	贝因美	5,159,546.00	3.41
146	600018	上港集团	5,138,769.00	3.40
147	002252	上海莱士	5,138,549.60	3.40
148	000538	云南白药	4,899,524.00	3.24
149	600188	兖州煤业	4,828,875.65	3.19
150	002463	沪电股份	4,723,085.00	3.12
151	001979	招商蛇口	4,577,102.00	3.03
152	600879	航天电子	4,552,140.50	3.01
153	000671	阳光城	4,539,574.00	3.00
154	000061	农产品	4,515,873.80	2.99
155	600056	中国医药	4,398,781.68	2.91
156	000021	深科技	4,352,684.00	2.88
157	600060	海信电器	4,301,460.00	2.85
158	300324	旋极信息	4,293,086.32	2.84
159	600380	健康元	4,292,838.00	2.84
160	601600	中国铝业	4,286,234.17	2.84
161	600009	上海机场	4,238,778.07	2.80
162	601258	庞大集团	4,151,855.00	2.75
163	000983	西山煤电	4,095,568.83	2.71
164	600300	维维股份	4,072,299.00	2.69
165	300136	信维通信	4,044,675.00	2.68
166	000050	深天马 A	4,032,667.00	2.67

167	600010	包钢股份	4,025,539.00	2.66
168	000046	泛海控股	3,978,149.00	2.63
169	300072	三聚环保	3,940,954.00	2.61
170	300133	华策影视	3,932,881.50	2.60
171	000581	威孚高科	3,888,258.00	2.57
172	002405	四维图新	3,868,154.00	2.56
173	600373	中文传媒	3,822,739.56	2.53
174	000997	新大陆	3,787,517.16	2.51
175	002310	东方园林	3,696,927.00	2.45
176	601231	环旭电子	3,650,302.00	2.42
177	000039	中集集团	3,650,094.00	2.41
178	000027	深圳能源	3,641,101.00	2.41
179	600369	西南证券	3,565,811.00	2.36
180	002437	誉衡药业	3,562,284.00	2.36
181	002195	二三四五	3,551,868.27	2.35
182	002482	广田集团	3,551,059.00	2.35
183	601111	中国国航	3,543,540.00	2.34
184	600161	天坛生物	3,491,160.39	2.31
185	000639	西王食品	3,459,310.00	2.29
186	600919	江苏银行	3,366,432.44	2.23
187	601766	中国中车	3,356,807.00	2.22
188	600153	建发股份	3,336,685.00	2.21
189	600518	康美药业	3,319,515.53	2.20
190	600233	圆通速递	3,280,887.75	2.17
191	300199	翰宇药业	3,273,302.80	2.17
192	002568	百润股份	3,241,805.53	2.14
193	002241	歌尔股份	3,235,505.00	2.14
194	300274	阳光电源	3,212,937.36	2.13
195	600549	厦门钨业	3,185,580.97	2.11
196	300257	开山股份	3,177,897.75	2.10
197	002236	大华股份	3,115,594.00	2.06

198	002422	科伦药业	3,025,397.67	2.00
-----	--------	------	--------------	------

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。

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	3,428,022,311.95
卖出股票收入（成交）总额	3,348,092,137.77

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。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	462,033.40	0.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	462,033.40	0.31

8.6 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	132013	17宝武EB	4,420	429,933.40	0.28
2	128024	宁行转债	321	32,100.00	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1806	IF1806	9	10,931,220.00	156,720.00	-
公允价值变动总额合计(元)					156,720.00
股指期货投资本期收益(元)					-2,660,820.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					156,720.00

8.10.2 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2016年9月20日，万华化学集团股份有限公司（下称“万华化学”，股票代码：600309）的烟台工业园发生了爆炸事故，根据事故安全调查结果，认定该爆炸事故是一起较大生产安全责任事故，事故造成4人死亡，4人受伤；直接经济损失573.62万元。根据烟台市人民政府批复的《万华化学集团股份有限公司烟台工业园“9.20”较大爆炸事故调查报告》的建议，万华化学对9名相关责任人给予相应责任追究，包括解除劳动合同、撤职、留厂查看、降级、记过、警告等处分；烟台市安监局对万华化学集团股份有限公司负责人处上一年收入40%的罚款，对万华化学集团股份有限公司处以80万元罚款。

本基金投研人员分析认为，在事故发生以及受到处罚后，万华化学认真吸取事故教训，改正态度积极，并迅速做出反应，查找不足，积极整改，进一步加强安全管理，该事件发生后该公司经营状况正常。另外，事故于一年前发生，事故对于该公司的影响已逐步变淡，对公司业绩影响有限。该公司目前经营状况良好。本基金基金经理依据基金

合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对万华化学进行了投资。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,988,235.80
2	应收证券清算款	288,064.90
3	应收股利	-
4	应收利息	7,926.18
5	应收申购款	104,869.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,389,096.26

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600309	万华化学	2,602,684.00	1.72	-

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
创金合信量化核心混合A	1,164	65,777.87	-	-	76,565,435.10	100.00%
创金合信量化核心混合C	893	65,422.28	-	-	58,422,095.95	100.00%
合计	2,024	66,693.44	-	-	134,987,531.05	100.00%

9.2 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	创金合信量化核心混合A	119,386.22	0.1600%
	创金合信量化核心混合C	37,065.78	0.0600%
	合计	156,452.00	0.1200%

9.3 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	创金合信量化核心	0~10

和研究部门负责人持有本开放式基金	混合A	
	创金合信量化核心混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信量化核心混合A	0
	创金合信量化核心混合C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信量化核心混合 A	创金合信量化核心混合 C
基金合同生效日(2017年03月27日)基金份额总额	269,241,417.75	532,756,314.04
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,412,980.46	43,302,236.41
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	205,088,963.11	517,636,454.50
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	76,565,435.10	58,422,095.95

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

11.5 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更换会计师事务所,本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用85,000.00元,该审计机构连续提供审计服务的年限为1年。

11.6 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,未出现管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	321,321,692.65	4.75%	72,298.70	2.78%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	1,407,036,188.05	20.78%	451,570.63	17.35%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	112,164,159.64	1.66%	59,974.09	2.30%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	9,755,764.83	0.14%	4,204.34	0.16%	-

国信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	36,616,465.83	0.54%	11,402.12	0.44%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	292,182,187.86	4.31%	64,691.63	2.49%	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	4,373,617,954.96	64.59%	1,846,178.64	70.93%	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
安信证券	4	15,389,841.84	0.23%	6,454.60	0.25%	-
银河证券	4	203,601,006.24	3.01%	86,177.06	3.31%	-

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。

本基金在报告期内成立，交易单元均于本期内新增。

11.7.2 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	占当期	成交	占当期	成	占当期	成	占当期

	交 金 额	债券成 交总额 的比例	金 额	债券回 购成交 总额的 比例	交 金 额	权证成 交总额 的比例	交 金 额	基金成 交总额 的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	1,285,000.00	9.61%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	813,000.00	6.08%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	9,229.50	1.29%	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	70 8,8 20. 21	98.71%	11,2 66,8 00,0 00.0 0	84.30%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本基金在报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

创金合信基金管理有限公司
二〇一八年三月三十一日