
创金合信量化多因子股票型证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 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

送出日期:2018 年 08 月 29 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2018年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
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	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	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	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
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	62
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	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
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	65
§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	66
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	66
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	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 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	931,896,721.25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	914,314,778.97份	17,581,942.28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1000指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	010-66105798
	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	010-66105799
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市福田区福华一路15号投行大厦15层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518000	100140
法定代表人		刘学民	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(2018年01月01日-2018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	-123,237,682.62	-3,206,350.28
本期利润	-136,795,895.70	-3,276,919.75
加权平均基金份额本期利润	-0.1645	-0.1281
本期加权平均净值利润率	-15.02%	-11.70%
本期基金份额净值增长率	-13.79%	-14.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-17,530,786.33	-521,834.97
期末可供分配基金份额利润	-0.0192	-0.0297
期末基金资产净值	896,783,992.64	17,060,107.31
期末基金份额净值	0.9808	0.9703
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.92%	-23.05%

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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	----------	----------	----------	----------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一 个月	-8.79%	1.91%	-9.85%	1.78%	1.06%	0.13%
过去三 个月	-12.68%	1.36%	-14.34%	1.29%	1.66%	0.07%
过去六 个月	-13.79%	1.35%	-15.55%	1.32%	1.76%	0.03%
过去一 年	-12.90%	1.12%	-13.24%	1.11%	0.34%	0.01%
自基金 合同生 效起至 今	-1.92%	1.05%	-6.99%	1.22%	5.07%	-0.17%

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	-8.84%	1.91%	-9.85%	1.78%	1.01%	0.13%
过去三 个月	-12.84%	1.36%	-14.34%	1.29%	1.50%	0.07%
过去六 个月	-14.11%	1.35%	-15.55%	1.32%	1.44%	0.03%
过去一 年	-13.52%	1.12%	-13.24%	1.11%	-0.28%	0.01%
自基金 合同生 效起至 今	-23.05%	1.08%	-15.59%	1.02%	-7.46%	0.06%

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



注：自 2018 年 6 月 11 日起，本基金的业绩比较基准由原来的“中证 500 指数收益率×90%+2%”变更为“中证 1000 指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率（税后）×10%”。上述事项已于 2018 年 6 月 7 日在指定媒体上公告。

§ 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11只公募基金。截至2018年6月30日，本公司共管理39只公募基金，其中混合型产品14只、指数型产品8只、债券型产品10只、股票型产品6只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约147.33亿元。

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 基金经 理、量 化投资 部总监	2016-01 -22	-	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11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	本基金基金经理	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日期；

2、证券从业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。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59次，该基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，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2018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，量化选股模型提供了选股依据；另一方面，仓位管理上我们严格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多因子股票A基金份额净值为0.9808元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.79%，同期业绩比较基准收益率为-15.55%；截至报告期末创金合信量化多因子股票C基金份额净值为0.9703元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-14.11%，同期业绩比较基准收益率为-15.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年，在去杠杆的大环境下，市场有所动荡，主流的指数均有所调整。边际上看，宏观经济仍处于复苏阶段，经济增速没有太大的风险；随着去杠杆取得一定成效，流动性边际上有所改善，对股市有一定的利好；估值的角度来看，以中证500和中证1000为代表的中小盘风格指数的估值处于历史底部位置，沪深300为代表的大盘蓝筹风格指数也处于估值偏低的位置，股票市场整体具备估值吸引力。在投资管理上，我们坚持严格采用量化模型进行投资运作。

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2018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：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2018年06月30日	2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	40,828,611.81	67,324,976.63
结算备付金		62,323,694.60	60,517,524.09
存出保证金		10,606,593.08	13,725,752.12
交易性金融资产	6.4.7.2	799,873,651.24	1,015,788,557.92
其中：股票投资		792,569,821.09	1,012,156,524.32
基金投资		-	-
债券投资		7,303,830.15	3,632,033.60
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		5,564,699.56	1,245,821.98
应收利息	6.4.7.5	188,046.53	35,613.74
应收股利		-	-
应收申购款		178,330.16	239,193.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		919,563,626.98	1,158,877,440.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,296,427.42	3,622,760.19
应付赎回款		819,016.40	2,386,290.87
应付管理人报酬		1,135,201.94	1,509,787.69
应付托管费		189,200.30	251,631.30

应付销售服务费		11,055.16	32,973.32
应付交易费用	6.4.7.7	2,160,278.57	2,257,842.78
应交税费		2.02	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,345.22	210,401.50
负债合计		5,719,527.03	10,271,687.65
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	931,896,721.25	1,009,924,932.46
未分配利润	6.4.7.1 0	-18,052,621.30	138,680,820.32
所有者权益合计		913,844,099.95	1,148,605,752.78
负债和所有者权益总计		919,563,626.98	1,158,877,440.43

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额总额931,896,721.25份，其中下属A类基金份额914,314,778.97份，C类基金份额17,581,942.28份。下属A类基金份额净值0.9808元，C类基金份额净值0.9703元。

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：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		-119,767,158.69	-147,840,406.37
1. 利息收入		745,497.34	1,321,592.59
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	737,322.79	652,191.96
债券利息收入		8,174.55	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
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-107,002,857.51	-198,117,630.69
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-106,455,964.06	-194,803,472.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	62,634.82	118,188.07
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-5,556,508.29	-9,962,972.73
股利收益	6.4.7.1 5	4,946,980.02	6,530,626.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-13,628,782.55	46,217,631.10
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	118,984.03	2,738,000.63
减：二、费用		20,305,656.76	36,551,906.50
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	6,959,958.69	13,633,997.84
2. 托管费	6.4.10. 2.2	1,159,993.10	2,272,333.01
3. 销售服务费	6.4.10. 2.3	104,048.76	187,450.96
4. 交易费用	6.4.7.1 8	11,960,218.72	20,358,236.69

5. 利息支出		692.76	-
其中：卖出回购金融资产支出		692.76	-
6. 税金及附加		2,628.59	-
7. 其他费用	6.4.7.1 9	118,116.14	99,888.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-140,072,815.45	-184,392,312.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-140,072,815.45	-184,392,312.87

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：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018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)	1,009,924,932.46	138,680,820.32	1,148,605,752.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-140,072,815.45	-140,072,815.45
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）	-78,028,211.21	-16,660,626.17	-94,688,837.38
其中：1. 基金申购款	229,612,232.22	18,837,916.89	248,450,149.11
2. 基金赎回款	-307,640,443.43	-35,498,543.06	-343,138,986.49

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）	931,896,721.25	-18,052,621.30	913,844,099.95
项 目	上年度可比期间 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

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。自基金合同生效日至2018年6月10日止期间,本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率 \times 90%+2%。根据本基金的基金管理人于2018年6月7日发布的《创金合信量化多因子股票型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》,自2018年6月11日起,本基金的业绩比较基准变更为:中证1000指数收益率 \times 90%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指

引》、《创金合信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

6.4.5.1 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 2018年06月30日
活期存款	40,828,611.81
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	40,828,611.81

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	824,446,829.66	792,569,821.09	-31,877,008.57	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	7,329,700.00	7,303,830.15	-25,869.85
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,329,700.00	7,303,830.15	-25,869.85
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	831,776,529.66	799,873,651.24	-31,902,878.42

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	49,770,560.00	-	-	-
股指期货	49,770,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	49,770,560.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

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 2018年06月30日
应收活期存款利息	9,107.98
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	115,959.35
应收债券利息	62,842.00
应收资产支持证券利息	-
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	137.20
合计	188,046.53

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 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	2,160,278.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,160,278.57

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	168.08
预提费用	108,177.14
合计	108,345.22

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 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2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	964,803,557.01	964,803,557.01
本期申购	228,823,217.71	228,823,217.71
本期赎回(以“-”号填列)	-279,311,995.75	-279,311,995.75
本期末	914,314,778.97	914,314,778.97

6.4.7.9.2 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2018年01月01日至2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	45,121,375.45	45,121,375.45
本期申购	789,014.51	789,014.51
本期赎回(以“-”号填列)	-28,328,447.68	-28,328,447.68
本期末	17,581,942.28	17,581,942.28

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 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	124,514,699.13	8,313,121.65	132,827,820.78
本期利润	-123,237,682.62	-13,558,213.08	-136,795,895.70
本期基金份额交易产生的变动数	-11,034,570.13	-2,528,141.28	-13,562,711.41
其中：基金申购款	17,710,547.27	1,062,823.24	18,773,370.51
基金赎回款	-28,745,117.40	-3,590,964.52	-32,336,081.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,757,553.62	-7,773,232.71	-17,530,786.33

6.4.7.10.2 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	5,466,454.07	386,545.47	5,852,999.54
本期利润	-3,206,350.28	-70,569.47	-3,276,919.75
本期基金份额交易产 生的变动数	-2,634,624.92	-463,289.84	-3,097,914.76
其中：基金申购款	63,130.62	1,415.76	64,546.38
基金赎回款	-2,697,755.54	-464,705.60	-3,162,461.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-374,521.13	-147,313.84	-521,834.97

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日
活期存款利息收入	255,088.28
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	478,651.56
其他	3,582.95
合计	737,322.79

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
卖出股票成交总额	6,375,793,831.67
减：卖出股票成本总额	6,482,249,795.73
买卖股票差价收入	-106,455,964.06

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
	2018年01月01日至2018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	62,634.82
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	62,634.82

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
	2018年01月01日至2018年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,203,920.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,137,300.00
减：应收利息总额	3,985.19
买卖债券差价收入	62,634.82

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2018年01月01日至2018年06月30日
期货投资	-5,534,650.00

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年01月01日至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,946,980.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,946,980.02

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-12,696,592.55
——股票投资	-12,774,189.10
——债券投资	77,596.55
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-932,190.00
——权证投资	-
——期货投资	-932,190.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-13,628,782.55

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
基金赎回费收入	114,350.53
转换费收入	4,633.50
合计	118,984.03

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日
交易所市场交易费用	11,953,139.23
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	7,079.49
合计	11,960,218.72

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018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	339.00
账户维护费	18,000.00
查询服务费	600.00
合计	118,116.14

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	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 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	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	512,106,425.85	4.05%	2,806,790,729.64	14.84%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	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

		比例		比例
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	800,000,000.00	17.71%

6.4.10.1.4应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018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	162,899.17	3.66%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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

		比 例		额 的 比 例
第一创业 证券股份 有限公司	1,851,102.90	20 .0 9%	-	-

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 2018年01月01日至201 8年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,959,958.69	13,633,997.84
其中: 支付销售机构的客户维护费	4,260,695.99	7,793,323.07

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年06月30日	上年度可比期间 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	1, 159, 993. 10	2, 272, 333. 01
----------------	-----------------	-----------------

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 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	0.00	22.28	22.28
工商银行	0.00	1,276.35	1,276.35
合计	-	1,298.63	1,298.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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

本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.75%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

本报告期及上年度可比期间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

本报告期末及上年度末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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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	40,828,611.81	255,088.28	147,877,256.53	399,241.14

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新发流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300008	天海防务	2018-06-19	重大事项停牌	4.81	2018-07-03	5.20	846,800	4,496,163.28	4,073,108.00	-
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大事项停牌	18.08	-	-	206,210	3,891,814.09	3,728,276.80	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大事项停牌	10.80	2018-08-07	9.63	247,400	2,845,342.81	2,671,920.00	-
300187	永清环保	2018-04-	重大事项	9.32	-	-	256,900	2,473,388.15	2,394,308.00	-

		09	停牌							
002270	华明装备	2018-05-03	重大事项停牌	5.81	2018-07-03	5.23	362,251	2,211,910.75	2,104,678.31	-
002171	楚江新材	2018-06-07	重大事项停牌	6.78	-	-	162,000	1,073,512.24	1,098,360.00	-
300111	向日葵	2018-06-04	重大事项停牌	2.74	-	-	387,600	1,124,440.64	1,062,024.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项停牌	5.84	2018-07-17	5.26	178,200	1,062,735.03	1,040,688.00	-
600052	浙江广厦	2018-04-02	重大事项停牌	3.73	2018-07-30	3.90	262,200	966,843.39	978,006.00	-
000669	金鸿控股	2018-05-18	重大事项停牌	7.25	2018-08-06	6.53	118,020	932,861.95	855,645.00	-
600768	宁波富邦	2018-06-14	重大事项停牌	11.04	-	-	46,800	523,150.73	516,672.00	-
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项停牌	15.27	-	-	13,940	230,392.32	212,863.80	-

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2018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2018年6月30日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

未评级债券为期限一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券等债券。

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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	3,071,786.60
AAA以下	277,230.15	560,247.00
未评级	7,026,600.00	0.00
合计	7,303,830.15	3,632,033.60

未评级债券为期限一年以上的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券等债券。

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证券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上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2018年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2018年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为825,505,224.55元，超过经确认的当日净赎回金额。于2018年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为2.28%，未超过15%。

同时，本基金的基金管理人合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

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2018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	40,828,611.81	-	-	-	40,828,611.81
结算备付金	62,323,694.60	-	-	-	62,323,694.60
存出保证金	10,606,593.08	-	-	-	10,606,593.08
交易性金融资产	7,026,600.00	-	277,230.15	792,569,821.09	799,873,651.24
应收证券清算款	-	-	-	5,564,699.56	5,564,699.56

应收利息	-	-	-	188,046.53	188,046.53
应收申购款	-	-	-	178,330.16	178,330.16
资产总计	120,785,499.49	-	277,230.15	798,500,897.34	919,563,626.98
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,296,427.42	1,296,427.42
应付赎回款	-	-	-	819,016.40	819,016.40
应付管理人报酬	-	-	-	1,135,201.94	1,135,201.94
应付托管费	-	-	-	189,200.30	189,200.30
应付销售服务费	-	-	-	11,055.16	11,055.16
应付交易费用	-	-	-	2,160,278.57	2,160,278.57
应交税费	-	-	-	2.02	2.02
其他负债	-	-	-	108,345.22	108,345.22
负债总计	-	-	-	5,719,527.03	5,719,527.03
利率敏感度缺口	120,785,499.49	-	277,230.15	792,781,370.31	913,844,099.95
上年度末2017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	67,324,976.63	-	-	-	67,324,976.63
结算备	60,517,524.09	-	-	-	60,517,524.09

付金					
存出保证金	13,725,752.12	-	-	-	13,725,752.12
交易性金融资产	-	3,071,786.60	560,247.00	1,012,156,524.32	1,015,788,557.92
应收证券清算款	-	-	-	1,245,821.98	1,245,821.98
应收利息	-	-	-	35,613.74	35,613.74
应收申购款	-	-	-	239,193.95	239,193.95
资产总计	141,568,252.84	3,071,786.60	560,247.00	1,013,677,153.99	1,158,877,440.43
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,622,760.19	3,622,760.19
应付赎回款	-	-	-	2,386,290.87	2,386,290.87
应付管理人报酬	-	-	-	1,509,787.69	1,509,787.69
应付托管费	-	-	-	251,631.30	251,631.30
应付销售服务费	-	-	-	32,973.32	32,973.32
应付交易费用	-	-	-	2,257,842.78	2,257,842.78
其他负债	-	-	-	210,401.50	210,401.50
负债总计	-	-	-	10,271,687.65	10,271,687.65
利率敏感度缺口	141,568,252.84	3,071,786.60	560,247.00	1,003,405,466.34	1,148,605,752.78

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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率上升25个基点	-13,188.28	0.00
	市场利率下降25个基点	13,244.93	0.00

于2017年12月31日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.32%,且均为可转换债券及可交换债券,因此市场利率的变动对于本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。

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	上年度末
----	-----	------

	2018年06月30日		2017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	792,569,821.09	86.73	1,012,156,524.32	88.12
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	792,569,821.09	86.73	1,012,156,524.32	88.12

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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	45,057,412.71	50,345,749.82
	比较基准下降5%资产净值变动	-45,057,412.71	-
	比较基准下降5%资产净值变动	-	-50,345,749.82

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2018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772,022,471.18元，第二层次的余额为27,851,180.06元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次956,415,505.92元，第二层次59,373,052.00元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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2018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(2017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) 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。

(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。

§ 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	792,569,821.09	86.19
	其中：股票	792,569,821.09	86.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,303,830.15	0.79
	其中：债券	7,303,830.15	0.79
	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	103,152,306.41	11.22
8	其他各项资产	16,537,669.33	1.80
9	合计	919,563,626.98	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	8,474,473.99	0.93
B	采矿业	11,313,733.70	1.24

C	制造业	490,826,996.80	53.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,302,802.48	1.78
E	建筑业	27,001,924.36	2.95
F	批发和零售业	32,205,256.24	3.52
G	交通运输、仓储和邮政业	24,416,765.60	2.67
H	住宿和餐饮业	3,519,695.18	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,643,042.99	8.39
J	金融业	5,409,364.00	0.59
K	房地产业	31,551,567.62	3.45
L	租赁和商务服务业	11,557,093.29	1.26
M	科学研究和技术服务业	9,959,801.85	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	18,001,893.92	1.97
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	8,877,845.20	0.97
S	综合	16,507,563.87	1.81
	合计	792,569,821.09	86.73

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	002374	丽鹏股份	1,170,043	5,698,109.41	0.62
2	000547	航天发展	648,400	5,064,004.00	0.55
3	300305	裕兴股份	836,300	5,059,615.00	0.55
4	000551	创元科技	867,653	5,023,710.87	0.55
5	300040	九洲电气	855,679	5,022,835.73	0.55
6	002487	大金重工	1,368,630	5,009,185.80	0.55
7	300346	南大光电	384,240	5,006,647.20	0.55

8	002406	远东传动	909,902	4,995,361.98	0.55
9	002663	普邦股份	1,679,035	4,986,733.95	0.55
10	002391	长青股份	389,650	4,979,727.00	0.54
11	600603	广汇物流	1,235,960	4,968,559.20	0.54
12	300150	世纪瑞尔	1,027,850	4,964,515.50	0.54
13	300351	永贵电器	396,100	4,963,133.00	0.54
14	300430	诚益通	500,780	4,962,729.80	0.54
15	002671	龙泉股份	1,111,800	4,958,628.00	0.54
16	002501	利源精制	799,200	4,955,040.00	0.54
17	600676	交运股份	996,240	4,951,312.80	0.54
18	000965	天保基建	1,118,300	4,942,886.00	0.54
19	600831	广电网络	815,030	4,906,480.60	0.54
20	002478	常宝股份	1,089,520	4,881,049.60	0.53
21	300427	红相股份	329,840	4,749,696.00	0.52
22	300190	维尔利	850,900	4,637,405.00	0.51
23	002380	科远股份	352,486	4,582,318.00	0.50
24	300200	高盟新材	548,103	4,549,254.90	0.50
25	002331	皖通科技	613,784	4,542,001.60	0.50
26	600805	悦达投资	888,309	4,530,375.90	0.50
27	600602	云赛智联	773,802	4,488,051.60	0.49
28	002687	乔治白	835,298	4,485,550.26	0.49
29	300442	普丽盛	266,604	4,465,617.00	0.49
30	002347	泰尔股份	1,136,100	4,464,873.00	0.49
31	002398	建研集团	881,017	4,449,135.85	0.49
32	002061	浙江交科	422,000	4,418,340.00	0.48
33	002495	佳隆股份	1,501,273	4,413,742.62	0.48
34	600491	龙元建设	629,300	4,398,807.00	0.48
35	000975	银泰资源	433,220	4,392,850.80	0.48
36	002440	闰土股份	350,050	4,092,084.50	0.45
37	300008	天海防务	846,800	4,073,108.00	0.45
38	300460	惠伦晶体	392,800	4,065,480.00	0.44

39	002559	亚威股份	569,218	4,035,755.62	0.44
40	002682	龙洲股份	488,555	4,020,807.65	0.44
41	002484	江海股份	613,900	4,014,906.00	0.44
42	300432	富临精工	457,000	4,003,320.00	0.44
43	300011	鼎汉技术	627,271	4,001,988.98	0.44
44	002144	宏达高科	357,793	3,996,547.81	0.44
45	002546	新联电子	1,071,298	3,995,941.54	0.44
46	300422	博世科	280,174	3,992,479.50	0.44
47	600888	新疆众和	707,100	3,980,973.00	0.44
48	000719	中原传媒	595,004	3,980,576.76	0.44
49	300119	瑞普生物	463,400	3,962,070.00	0.43
50	300381	溢多利	449,200	3,912,532.00	0.43
51	002091	江苏国泰	609,400	3,869,690.00	0.42
52	603023	威帝股份	660,603	3,811,679.31	0.42
53	000666	经纬纺机	206,210	3,728,276.80	0.41
54	300485	赛升药业	255,300	3,673,767.00	0.40
55	300303	聚飞光电	1,324,500	3,629,130.00	0.40
56	002454	松芝股份	611,710	3,590,737.70	0.39
57	002335	科华恒盛	197,800	3,570,290.00	0.39
58	300395	菲利华	262,250	3,566,600.00	0.39
59	002261	拓维信息	773,900	3,559,940.00	0.39
60	002097	山河智能	542,900	3,550,566.00	0.39
61	300292	吴通控股	962,500	3,522,750.00	0.39
62	000524	岭南控股	385,087	3,519,695.18	0.39
63	000058	深赛格	687,000	3,517,440.00	0.38
64	002349	精华制药	601,900	3,515,096.00	0.38
65	002403	爱仕达	388,145	3,497,186.45	0.38
66	002187	广百股份	422,850	3,484,284.00	0.38
67	000705	浙江震元	548,176	3,480,917.60	0.38
68	001696	宗申动力	709,900	3,478,510.00	0.38
69	000758	中色股份	772,300	3,475,350.00	0.38

70	000833	贵糖股份	664,200	3,473,766.00	0.38
71	002449	国星光电	325,562	3,463,979.68	0.38
72	601717	郑煤机	594,400	3,453,464.00	0.38
73	002255	海陆重工	660,102	3,419,328.36	0.37
74	002205	国统股份	283,881	3,389,539.14	0.37
75	002543	万和电气	170,100	3,286,332.00	0.36
76	300488	恒锋工具	108,229	3,212,236.72	0.35
77	002279	久其软件	324,050	3,211,335.50	0.35
78	300297	蓝盾股份	380,200	3,083,422.00	0.34
79	002401	中远海科	307,000	3,079,210.00	0.34
80	002649	博彦科技	337,121	3,074,543.52	0.34
81	300473	德尔股份	79,983	3,035,354.85	0.33
82	000997	新大陆	192,151	3,026,378.25	0.33
83	002360	同德化工	553,900	3,018,755.00	0.33
84	002519	银河电子	678,830	3,014,005.20	0.33
85	300035	中科电气	556,000	3,013,520.00	0.33
86	002654	万润科技	545,700	2,995,893.00	0.33
87	300405	科隆股份	335,860	2,995,871.20	0.33
88	000548	湖南投资	683,024	2,991,645.12	0.33
89	300438	鹏辉能源	154,800	2,989,188.00	0.33
90	000592	平潭发展	1,048,800	2,978,592.00	0.33
91	000404	华意压缩	686,873	2,974,160.09	0.33
92	000880	潍柴重机	385,400	2,963,726.00	0.32
93	600649	城投控股	483,800	2,960,856.00	0.32
94	002588	史丹利	571,100	2,958,298.00	0.32
95	600639	浦东金桥	236,081	2,946,290.88	0.32
96	600706	曲江文旅	258,520	2,921,276.00	0.32
97	002593	日上集团	857,879	2,899,631.02	0.32
98	002243	通产丽星	512,215	2,894,014.75	0.32
99	300118	东方日升	247,400	2,671,920.00	0.29
100	002642	荣之联	279,950	2,572,740.50	0.28

101	300463	迈克生物	102,636	2,558,715.48	0.28
102	300231	银信科技	333,500	2,534,600.00	0.28
103	002231	奥维通信	434,934	2,531,315.88	0.28
104	002026	山东威达	412,610	2,525,173.20	0.28
105	300069	金利华电	211,300	2,522,922.00	0.28
106	002298	中电兴发	356,700	2,518,302.00	0.28
107	002420	毅昌股份	612,700	2,518,197.00	0.28
108	000631	顺发恒业	732,200	2,511,446.00	0.27
109	002603	以岭药业	179,400	2,508,012.00	0.27
110	300041	回天新材	273,600	2,503,440.00	0.27
111	600475	华光股份	234,102	2,502,550.38	0.27
112	300446	乐凯新材	135,880	2,501,550.80	0.27
113	002400	省广集团	773,300	2,497,759.00	0.27
114	000153	丰原药业	392,100	2,497,677.00	0.27
115	002402	和而泰	300,800	2,496,640.00	0.27
116	300489	中飞股份	174,500	2,495,350.00	0.27
117	300285	国瓷材料	125,100	2,494,494.00	0.27
118	600168	武汉控股	385,263	2,488,798.98	0.27
119	002393	力生制药	101,633	2,487,975.84	0.27
120	002311	海大集团	117,900	2,487,690.00	0.27
121	002304	洋河股份	18,900	2,487,240.00	0.27
122	600781	辅仁药业	158,132	2,482,672.40	0.27
123	600557	康缘药业	201,000	2,482,350.00	0.27
124	002580	圣阳股份	398,400	2,482,032.00	0.27
125	002112	三变科技	371,605	2,471,173.25	0.27
126	600064	南京高科	336,200	2,467,708.00	0.27
127	600420	现代制药	236,700	2,461,680.00	0.27
128	300306	远方信息	263,600	2,456,752.00	0.27
129	600658	电子城	469,620	2,456,112.60	0.27
130	600736	苏州高新	404,600	2,447,830.00	0.27
131	002653	海思科	202,000	2,424,000.00	0.27

132	300187	永清环保	256,900	2,394,308.00	0.26
133	600248	延长化建	517,500	2,323,575.00	0.25
134	002107	沃华医药	251,100	2,312,631.00	0.25
135	002270	华明装备	362,251	2,104,678.31	0.23
136	300121	阳谷华泰	147,100	2,063,813.00	0.23
137	300409	道氏技术	51,100	2,049,621.00	0.22
138	600331	宏达股份	786,000	2,035,740.00	0.22
139	002544	杰赛科技	148,700	2,035,703.00	0.22
140	002217	合力泰	245,900	2,028,675.00	0.22
141	002636	金安国纪	250,800	2,023,956.00	0.22
142	300295	三六五网	151,900	2,023,308.00	0.22
143	002093	国脉科技	262,200	2,021,562.00	0.22
144	300204	舒泰神	186,740	2,020,526.80	0.22
145	600101	明星电力	282,500	2,014,225.00	0.22
146	600662	强生控股	504,700	2,013,753.00	0.22
147	002315	焦点科技	139,200	2,012,832.00	0.22
148	002334	英威腾	343,800	2,011,230.00	0.22
149	002017	东信和平	323,256	2,007,419.76	0.22
150	002667	鞍重股份	325,910	2,001,087.40	0.22
151	300308	中际旭创	33,300	1,999,332.00	0.22
152	600257	大湖股份	435,101	1,997,113.59	0.22
153	002022	科华生物	167,600	1,986,060.00	0.22
154	000407	胜利股份	480,600	1,984,878.00	0.22
155	600664	哈药股份	499,900	1,984,603.00	0.22
156	002561	徐家汇	219,100	1,982,855.00	0.22
157	002224	三力士	332,600	1,982,296.00	0.22
158	300398	飞凯材料	101,300	1,981,428.00	0.22
159	600461	洪城水业	314,930	1,977,760.40	0.22
160	000777	中核科技	211,600	1,976,344.00	0.22
161	000541	佛山照明	329,867	1,975,903.33	0.22
162	002064	华峰氨纶	477,800	1,973,314.00	0.22

163	600705	中航资本	421,700	1,969,339.00	0.22
164	600081	东风科技	194,787	1,967,348.70	0.22
165	000623	吉林敖东	108,680	1,954,066.40	0.21
166	300149	量子生物	109,600	1,806,208.00	0.20
167	300378	鼎捷软件	124,400	1,561,220.00	0.17
168	002626	金达威	89,100	1,545,885.00	0.17
169	300232	洲明科技	155,100	1,532,388.00	0.17
170	300052	中青宝	143,500	1,529,710.00	0.17
171	002775	文科园林	115,990	1,528,748.20	0.17
172	002551	尚荣医疗	247,300	1,520,895.00	0.17
173	300058	蓝色光标	266,800	1,520,760.00	0.17
174	002245	澳洋顺昌	234,923	1,519,951.81	0.17
175	300276	三丰智能	124,400	1,515,192.00	0.17
176	300371	汇中股份	99,600	1,514,916.00	0.17
177	600775	南京熊猫	267,617	1,514,712.22	0.17
178	300050	世纪鼎利	252,200	1,513,200.00	0.17
179	300213	佳讯飞鸿	240,100	1,512,630.00	0.17
180	603558	健盛集团	171,575	1,511,575.75	0.17
181	002463	沪电股份	404,000	1,510,960.00	0.17
182	002783	凯龙股份	183,540	1,510,534.20	0.17
183	600973	宝胜股份	413,150	1,507,997.50	0.17
184	002724	海洋王	269,633	1,507,248.47	0.16
185	002533	金杯电工	310,300	1,504,955.00	0.16
186	300151	昌红科技	259,000	1,504,790.00	0.16
187	600288	大恒科技	193,800	1,503,888.00	0.16
188	002095	生意宝	41,900	1,503,791.00	0.16
189	600710	苏美达	347,902	1,502,936.64	0.16
190	300172	中电环保	266,400	1,499,832.00	0.16
191	600640	号百控股	147,358	1,498,630.86	0.16
192	000887	中鼎股份	103,900	1,497,199.00	0.16
193	300240	飞力达	246,916	1,496,310.96	0.16

194	600592	龙溪股份	243,300	1,496,295.00	0.16
195	600480	凌云股份	155,500	1,495,910.00	0.16
196	000753	漳州发展	504,902	1,489,460.90	0.16
197	300193	佳士科技	258,086	1,489,156.22	0.16
198	300217	东方电热	620,400	1,488,960.00	0.16
199	300239	东宝生物	351,864	1,488,384.72	0.16
200	300511	雪榕生物	167,600	1,488,288.00	0.16
201	600995	文山电力	198,141	1,488,038.91	0.16
202	002078	太阳纸业	153,500	1,487,415.00	0.16
203	600894	广日股份	250,784	1,487,149.12	0.16
204	601107	四川成渝	433,200	1,485,876.00	0.16
205	300452	山河药辅	103,350	1,485,139.50	0.16
206	002060	粤水电	506,800	1,484,924.00	0.16
207	600088	中视传媒	156,820	1,483,517.20	0.16
208	603979	金诚信	173,830	1,482,769.90	0.16
209	000026	飞亚达A	168,100	1,482,642.00	0.16
210	600160	巨化股份	202,500	1,482,300.00	0.16
211	600057	厦门象屿	296,957	1,481,815.43	0.16
212	002599	盛通股份	141,900	1,480,017.00	0.16
213	600548	深高速	188,338	1,478,453.30	0.16
214	002200	云投生态	205,780	1,477,500.40	0.16
215	002535	林州重机	392,830	1,477,040.80	0.16
216	002314	南山控股	366,400	1,476,592.00	0.16
217	002498	汉缆股份	666,700	1,473,407.00	0.16
218	300126	锐奇股份	300,200	1,467,978.00	0.16
219	600816	安信信托	202,100	1,463,204.00	0.16
220	601928	凤凰传媒	240,400	1,461,632.00	0.16
221	000858	五粮液	19,200	1,459,200.00	0.16
222	600551	时代出版	164,636	1,455,382.24	0.16
223	000529	广弘控股	258,000	1,449,960.00	0.16
224	600590	泰豪科技	223,460	1,441,317.00	0.16

225	300113	顺网科技	80,200	1,396,282.00	0.15
226	000568	泸州老窖	22,900	1,393,694.00	0.15
227	300154	瑞凌股份	244,000	1,244,400.00	0.14
228	603100	川仪股份	136,539	1,153,754.55	0.13
229	002171	楚江新材	162,000	1,098,360.00	0.12
230	000622	恒立实业	334,012	1,078,858.76	0.12
231	300499	高澜股份	73,400	1,072,374.00	0.12
232	300111	向日葵	387,600	1,062,024.00	0.12
233	002422	科伦药业	32,500	1,043,250.00	0.11
234	000415	渤海金控	178,200	1,040,688.00	0.11
235	300352	北信源	256,900	1,037,876.00	0.11
236	002662	京威股份	244,400	1,026,480.00	0.11
237	300183	东软载波	66,400	1,020,568.00	0.11
238	002474	榕基软件	128,100	1,015,833.00	0.11
239	002373	千方科技	77,800	1,015,290.00	0.11
240	002232	启明信息	129,800	1,013,738.00	0.11
241	601311	骆驼股份	88,244	1,012,158.68	0.11
242	002414	高德红外	75,100	1,009,344.00	0.11
243	300320	海达股份	189,298	1,008,958.34	0.11
244	600386	北巴传媒	259,202	1,008,295.78	0.11
245	300400	劲拓股份	74,600	1,007,846.00	0.11
246	002214	大立科技	184,100	1,007,027.00	0.11
247	000716	黑芝麻	277,800	1,005,636.00	0.11
248	300184	力源信息	93,800	1,005,536.00	0.11
249	600665	天地源	282,941	1,004,440.55	0.11
250	300006	莱美药业	241,200	1,003,392.00	0.11
251	002438	江苏神通	168,000	1,002,960.00	0.11
252	300039	上海凯宝	172,800	1,002,240.00	0.11
253	603309	维力医疗	83,100	1,002,186.00	0.11
254	002233	塔牌集团	87,500	1,001,000.00	0.11
255	002341	新纶科技	75,300	1,000,737.00	0.11

256	002276	万马股份	171,287	1,000,316.08	0.11
257	002238	天威视讯	148,504	999,431.92	0.11
258	002582	好想你	91,900	998,953.00	0.11
259	002631	德尔未来	134,900	998,260.00	0.11
260	600861	北京城乡	145,274	998,032.38	0.11
261	000919	金陵药业	133,238	997,952.62	0.11
262	300283	温州宏丰	220,200	997,506.00	0.11
263	002614	奥佳华	48,200	997,258.00	0.11
264	300275	梅安森	110,800	997,200.00	0.11
265	000159	国际实业	273,100	996,815.00	0.11
266	000419	通程控股	205,500	996,675.00	0.11
267	600969	郴电国际	166,102	996,612.00	0.11
268	002717	岭南股份	101,488	995,597.28	0.11
269	002661	克明面业	77,143	995,144.70	0.11
270	600368	五洲交通	310,900	994,880.00	0.11
271	002526	山东矿机	306,063	994,704.75	0.11
272	002031	巨轮智能	456,200	994,516.00	0.11
273	000652	泰达股份	318,600	994,032.00	0.11
274	600620	天宸股份	156,000	993,720.00	0.11
275	300470	日机密封	21,153	993,556.41	0.11
276	002404	嘉欣丝绸	162,772	992,909.20	0.11
277	000722	湖南发展	163,300	992,864.00	0.11
278	000903	云内动力	387,720	992,563.20	0.11
279	002472	双环传动	115,800	992,406.00	0.11
280	600823	世茂股份	237,400	992,332.00	0.11
281	300082	奥克股份	203,202	991,625.76	0.11
282	300399	京天利	96,460	991,608.80	0.11
283	300159	新研股份	140,000	991,200.00	0.11
284	000682	东方电子	258,000	990,720.00	0.11
285	000417	合肥百货	172,200	990,150.00	0.11
286	600731	湖南海利	199,600	990,016.00	0.11

287	002009	天奇股份	82,700	989,919.00	0.11
288	600565	迪马股份	335,500	989,725.00	0.11
289	002125	湘潭电化	135,520	989,296.00	0.11
290	600748	上实发展	196,100	988,344.00	0.11
291	000589	黔轮胎 A	300,326	988,072.54	0.11
292	000966	长源电力	356,600	987,782.00	0.11
293	000582	北部湾港	130,400	987,128.00	0.11
294	600337	美克家居	168,400	986,824.00	0.11
295	300021	大禹节水	190,300	985,754.00	0.11
296	002623	亚玛顿	57,400	983,836.00	0.11
297	000552	靖远煤电	300,300	981,981.00	0.11
298	600256	广汇能源	239,800	980,782.00	0.11
299	002750	龙津药业	136,500	980,070.00	0.11
300	300435	中泰股份	92,701	979,849.57	0.11
301	000969	安泰科技	156,700	979,375.00	0.11
302	000042	中洲控股	66,000	978,780.00	0.11
303	000012	南玻 A	197,590	978,070.50	0.11
304	600052	浙江广厦	262,200	978,006.00	0.11
305	601965	中国汽研	116,652	977,543.76	0.11
306	603123	翠微股份	159,575	973,407.50	0.11
307	002295	精艺股份	144,100	968,352.00	0.11
308	600143	金发科技	185,400	967,788.00	0.11
309	603822	嘉澳环保	33,400	966,930.00	0.11
310	002330	得利斯	179,200	951,552.00	0.10
311	300284	苏交科	119,600	948,428.00	0.10
312	000786	北新建材	50,200	930,206.00	0.10
313	000669	金鸿控股	118,020	855,645.00	0.09
314	000971	高升控股	185,600	803,648.00	0.09
315	002105	信隆健康	148,800	672,576.00	0.07
316	000555	神州信息	40,200	533,856.00	0.06
317	002746	仙坛股份	47,000	532,980.00	0.06

318	002148	北纬科技	90,300	523,740.00	0.06
319	300120	经纬辉开	77,317	518,023.90	0.06
320	600768	宁波富邦	46,800	516,672.00	0.06
321	600352	浙江龙盛	43,000	513,850.00	0.06
322	603808	歌力思	22,800	513,228.00	0.06
323	300386	飞天诚信	43,600	513,172.00	0.06
324	002316	亚联发展	55,751	512,909.20	0.06
325	300476	胜宏科技	33,300	512,820.00	0.06
326	300020	银江股份	53,900	512,589.00	0.06
327	002452	长高集团	125,900	512,413.00	0.06
328	002073	软控股份	88,800	510,600.00	0.06
329	300444	双杰电气	33,600	510,048.00	0.06
330	300007	汉威科技	40,300	509,392.00	0.06
331	002253	川大智胜	35,100	509,301.00	0.06
332	000617	中油资本	45,200	508,048.00	0.06
333	300467	迅游科技	15,800	507,180.00	0.06
334	002206	海利得	101,400	505,986.00	0.06
335	600237	铜峰电子	133,801	505,767.78	0.06
336	600448	华纺股份	103,000	505,730.00	0.06
337	002740	爱迪尔	66,100	505,665.00	0.06
338	603227	雪峰科技	130,300	505,564.00	0.06
339	300098	高新兴	63,300	505,134.00	0.06
340	300509	新美星	41,950	504,658.50	0.06
341	300018	中元股份	99,500	504,465.00	0.06
342	002587	奥拓电子	78,300	504,252.00	0.06
343	300482	万孚生物	7,200	504,000.00	0.06
344	300100	双林股份	46,000	503,700.00	0.06
345	002126	银轮股份	55,800	503,316.00	0.06
346	600655	豫园股份	53,200	502,740.00	0.06
347	002209	达意隆	69,400	502,456.00	0.05
348	300252	金信诺	55,390	502,387.30	0.05

349	300160	秀强股份	119,600	502,320.00	0.05
350	600824	益民集团	142,287	502,273.11	0.05
351	002338	奥普光电	46,502	502,221.60	0.05
352	600078	澄星股份	145,100	502,046.00	0.05
353	601599	鹿港文化	123,344	502,010.08	0.05
354	002139	拓邦股份	88,200	501,858.00	0.05
355	002613	北玻股份	159,280	501,732.00	0.05
356	000826	启迪桑德	28,700	501,676.00	0.05
357	300129	泰胜风能	138,900	501,429.00	0.05
358	300419	浩丰科技	77,500	501,425.00	0.05
359	002476	宝莫股份	116,300	501,253.00	0.05
360	300414	中光防雷	29,800	501,236.00	0.05
361	002291	星期六	104,800	500,944.00	0.05
362	002575	群兴玩具	126,100	500,617.00	0.05
363	300227	光韵达	46,200	499,884.00	0.05
364	300211	亿通科技	93,257	499,857.52	0.05
365	000848	承德露露	47,200	499,848.00	0.05
366	002421	达实智能	123,400	499,770.00	0.05
367	000838	财信发展	135,400	499,626.00	0.05
368	002363	隆基机械	88,100	499,527.00	0.05
369	002429	兆驰股份	201,300	499,224.00	0.05
370	000668	荣丰控股	45,663	499,096.59	0.05
371	300321	同大股份	34,941	498,957.48	0.05
372	002353	杰瑞股份	30,700	498,875.00	0.05
373	000635	英力特	53,800	498,726.00	0.05
374	600829	人民同泰	69,650	498,694.00	0.05
375	600278	东方创业	63,200	498,648.00	0.05
376	600605	汇通能源	56,722	498,586.38	0.05
377	600624	复旦复华	96,786	498,447.90	0.05
378	600613	神奇制药	81,300	498,369.00	0.05
379	600580	卧龙电气	65,400	498,348.00	0.05

380	002133	广宇集团	115,000	497,950.00	0.05
381	600218	全柴动力	99,900	497,502.00	0.05
382	600976	健民集团	23,694	497,337.06	0.05
383	600330	天通股份	72,600	497,310.00	0.05
384	000828	东莞控股	62,300	497,154.00	0.05
385	002158	汉钟精机	55,360	497,132.80	0.05
386	600279	重庆港九	111,959	497,097.96	0.05
387	000876	新希望	78,400	497,056.00	0.05
388	002566	益盛药业	70,700	497,021.00	0.05
389	300349	金卡智能	25,830	496,969.20	0.05
390	600058	五矿发展	59,800	496,938.00	0.05
391	000906	浙商中拓	96,676	496,914.64	0.05
392	600470	六国化工	134,300	496,910.00	0.05
393	002337	赛象科技	145,700	496,837.00	0.05
394	600757	长江传媒	87,300	496,737.00	0.05
395	601369	陕鼓动力	77,600	496,640.00	0.05
396	002244	滨江集团	95,500	496,600.00	0.05
397	300214	日科化学	105,800	496,202.00	0.05
398	000099	中信海直	78,000	496,080.00	0.05
399	600623	华谊集团	49,700	496,006.00	0.05
400	002658	雪迪龙	63,500	495,935.00	0.05
401	002164	宁波东力	85,800	495,924.00	0.05
402	000785	武汉中商	64,400	495,880.00	0.05
403	601566	九牧王	33,600	495,600.00	0.05
404	600742	一汽富维	40,520	495,559.60	0.05
405	000686	东北证券	77,300	495,493.00	0.05
406	000027	深圳能源	100,301	495,486.94	0.05
407	603788	宁波高发	20,100	495,264.00	0.05
408	002287	奇正藏药	17,200	495,188.00	0.05
409	002046	轴研科技	73,143	495,178.11	0.05
410	603601	再升科技	56,500	494,940.00	0.05

411	002383	合众思壮	29,900	494,845.00	0.05
412	300354	东华测试	51,053	494,703.57	0.05
413	600708	光明地产	115,040	494,672.00	0.05
414	601908	京运通	108,000	494,640.00	0.05
415	002090	金智科技	34,200	494,532.00	0.05
416	002550	千红制药	88,400	494,156.00	0.05
417	002367	康力电梯	82,900	494,084.00	0.05
418	600505	西昌电力	107,390	493,994.00	0.05
419	300025	华星创业	119,600	493,948.00	0.05
420	600306	商业城	76,300	493,661.00	0.05
421	000088	盐田港	74,900	493,591.00	0.05
422	300477	合纵科技	25,600	493,568.00	0.05
423	002249	大洋电机	114,500	493,495.00	0.05
424	600308	华泰股份	99,000	493,020.00	0.05
425	002534	杭锅股份	72,800	492,856.00	0.05
426	002084	海鸥住工	103,541	492,855.16	0.05
427	600777	新潮能源	225,000	492,750.00	0.05
428	600611	大众交通	123,800	492,724.00	0.05
429	002531	天顺风能	113,200	492,420.00	0.05
430	600061	国投资本	53,000	491,840.00	0.05
431	600153	建发股份	54,700	491,753.00	0.05
432	000767	漳泽电力	192,500	490,875.00	0.05
433	300103	达刚路机	61,200	490,824.00	0.05
434	002135	东南网架	96,800	490,776.00	0.05
435	000005	世纪星源	165,800	490,768.00	0.05
436	600284	浦东建设	100,500	490,440.00	0.05
437	600170	上海建工	161,100	489,744.00	0.05
438	600511	国药股份	18,155	489,277.25	0.05
439	600629	华建集团	41,000	489,130.00	0.05
440	300309	吉艾科技	24,100	488,748.00	0.05
441	002379	宏创控股	147,100	488,372.00	0.05

442	000637	茂化实华	111,500	488,370.00	0.05
443	603599	广信股份	34,000	488,240.00	0.05
444	600037	歌华有线	47,300	488,136.00	0.05
445	000531	穗恒运 A	97,200	487,944.00	0.05
446	300245	天玑科技	47,800	487,560.00	0.05
447	002034	旺能环境	24,600	487,326.00	0.05
448	002728	特一药业	30,700	485,060.00	0.05
449	000925	众合科技	78,080	484,096.00	0.05
450	300181	佐力药业	88,000	484,000.00	0.05
451	002010	传化智联	39,700	482,355.00	0.05
452	002488	金固股份	44,700	482,313.00	0.05
453	000043	中航善达	68,000	482,120.00	0.05
454	002576	通达动力	53,100	481,617.00	0.05
455	000563	陕国投 A	141,600	481,440.00	0.05
456	002399	海普瑞	21,700	480,438.00	0.05
457	300506	名家汇	23,100	478,863.00	0.05
458	300357	我武生物	12,000	478,440.00	0.05
459	300257	开山股份	31,200	477,048.00	0.05
460	600310	桂东电力	120,592	476,338.40	0.05
461	002250	联化科技	54,000	476,280.00	0.05
462	603898	好莱客	18,000	472,320.00	0.05
463	300179	四方达	93,400	467,934.00	0.05
464	000036	华联控股	74,100	440,154.00	0.05
465	300028	*金亚	157,600	362,480.00	0.04
466	002591	恒大高新	30,100	223,041.00	0.02
467	002051	中工国际	13,940	212,863.80	0.02
468	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
469	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.01
470	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
471	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.01
472	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00

473	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00
-----	--------	------	-------	-----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000551	创元科技	21,107,784.18	1.84
2	002463	沪电股份	18,701,795.99	1.63
3	600676	交运股份	18,675,247.32	1.63
4	000700	模塑科技	18,648,549.96	1.62
5	600548	深高速	18,162,351.63	1.58
6	601717	郑煤机	18,054,460.75	1.57
7	600331	宏达股份	17,155,014.00	1.49
8	603979	金诚信	16,667,288.91	1.45
9	000902	新洋丰	16,509,130.68	1.44
10	002091	江苏国泰	16,459,024.67	1.43
11	600736	苏州高新	15,915,336.51	1.39
12	002334	英威腾	15,907,381.35	1.38
13	002449	国星光电	15,900,734.98	1.38
14	002247	帝龙文化	15,836,673.10	1.38
15	002682	龙洲股份	15,799,506.64	1.38
16	603328	依顿电子	15,727,390.76	1.37
17	002100	天康生物	15,691,345.95	1.37
18	300050	世纪鼎利	15,666,118.05	1.36
19	002518	科士达	15,600,836.75	1.36
20	000040	东旭蓝天	15,545,878.34	1.35

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	002247	帝龙文化	24,517,762.99	2.13
2	000902	新洋丰	21,099,386.11	1.84
3	002518	科士达	20,186,945.04	1.76
4	300297	蓝盾股份	19,872,148.92	1.73
5	600057	厦门象屿	19,457,565.95	1.69
6	600173	卧龙地产	19,436,875.78	1.69
7	002334	英威腾	19,228,411.36	1.67
8	002608	江苏国信	19,009,878.84	1.66
9	300194	福安药业	18,586,783.45	1.62
10	600750	江中药业	18,560,685.01	1.62
11	002449	国星光电	18,336,606.83	1.60
12	600736	苏州高新	17,799,857.65	1.55
13	002091	江苏国泰	17,595,026.62	1.53
14	002139	拓邦股份	17,378,863.03	1.51
15	002454	松芝股份	17,142,090.13	1.49
16	000027	深圳能源	17,106,832.40	1.49
17	600101	明星电力	17,020,026.09	1.48
18	000069	华侨城 A	16,938,302.53	1.47
19	000700	模塑科技	16,879,242.18	1.47
20	600757	长江传媒	16,867,323.30	1.47

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

买入股票成本(成交)总额	6,275,437,281.60
卖出股票收入(成交)总额	6,375,793,831.67

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,026,600.00	0.77
	其中：政策性金融债	7,026,600.00	0.77
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)	277,230.15	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,303,830.15	0.80

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	018005	国开1701	70,000	7,026,600.00	0.77
2	128018	时达转债	3,195	277,230.15	0.03

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(买/	合约市值	公允价值	风险说明
----	----	--------	------	------	------

		卖)		变动	
IC1807	IC1807	18	18,676,800.00	427,680.00	符合本基金的收益风险特征
IC1809	IC1809	2	2,045,040.00	49,120.00	符合本基金的收益风险特征
IC1812	IC1812	29	29,048,720.00	-480,710.00	符合本基金的收益风险特征
公允价值变动总额合计（元）					-3,910.00
股指期货投资本期收益（元）					-5,534,650.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-932,190.00

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	10,606,593.08
2	应收证券清算款	5,564,699.56
3	应收股利	-
4	应收利息	188,046.53
5	应收申购款	178,330.16

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,537,669.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128018	时达转债	277,230.15	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(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	34,259	26,688.31	194,106,724.70	21.23%	720,208,054.27	78.77%
创金合信量化多因	3,362	5,229.61	9,246,886.54	52.59%	8,335,055.74	47.41%

子股票C						
合计	37,358	24,945.04	203,353,611.24	21.82%	728,543,110.01	78.18%

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	772,078.35	0.08%
	创金合信量化多因子股票C	86,672.93	0.49%
	合计	858,751.28	0.09%

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
	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
	创金合信量化多因子股票C	0
	合计	0

§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	1,489,891,025.73
本报告期期初基金份额总额	964,803,557.01	45,121,375.45
本报告期基金总申购份额	228,823,217.71	789,014.51
减:本报告期基金总赎回份额	279,311,995.75	28,328,447.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	914,314,778.97	17,581,942.28

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内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	交易单	股票交易		应支付该券商的佣金		备

	元数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
华安证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	1,429,371,216.96	11.30%	604,387.36	13.57%	-
第一创业证券	2	512,106,425.85	4.05%	162,899.17	3.66%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	1,208,721,268.85	9.56%	385,854.95	8.66%	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	2,173,554,025.61	17.19%	909,964.20	20.43%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

光大证券	2	776,632,407.05	6.14%	323,127.34	7.25%	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	659,898,671.02	5.22%	275,673.60	6.19%	-
东兴证券	2	978,591,897.42	7.74%	308,906.48	6.93%	-
中泰证券	2	1,312,668,264.93	10.38%	413,670.55	9.29%	-
长江证券	2	2,173,779,959.02	17.19%	473,827.80	10.64%	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-

安信 证券	4	1,422,630,967.87	11.25%	596,109.14	13.38%	-
----------	---	------------------	--------	------------	--------	---

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方正证券、中金公司、江海证券、恒泰证券4家券商的8个交易单元，退租金元证券的2个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	5,007,000.00	44.66%	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证	3,168,009.92	28.26%	-	-	-	-	-	-

券								
江海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	264,185.00	2.36%	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	2,003,200.00	17.87%	6,800,000.00	100.00%	-	-	-	-
西藏东 方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	106,476.43	0.95%	-	-	-	-	-	-
长江证 券	661,441.75	5.90%	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证 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 旗下基金资产净值公告	公司官网、证券时报	2018-01-02
2	创金合信量化多因子股票型 证券投资基金2017年第4季 度报告	公司官网、证券时报	2018-01-19

3	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苏宁金融为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2018-01-29
4	创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	公司官网、证券时报	2018-02-10
5	创金合信量化多因子股票型证券投资基金（2018年第1次）招募说明书（更新）	公司官网、证券时报	2018-03-07
6	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（2018年第1号）	公司官网、证券时报	2018-03-07
7	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修订基金合同、托管协议部分条款的公告	公司官网、证券时报	2018-03-28
8	创金合信量化多因子股票型证券投资基金（2018年第1次）招募说明书（更新）（2018年3月修订）	公司官网、证券时报	2018-03-28
9	创金合信量化多因子股票型证券投资基金基金合同（2018年3月修订）	公司官网、证券时报	2018-03-28
10	创金合信量化多因子股票型证券投资基金托管协议（2018年3月修订）	公司官网、证券时报	2018-03-28
11	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（2018年第1号）（2018年3月修订）	公司官网、证券时报	2018-03-28

12	创金合信基金管理有限公司 关于公司旗下部分基金估值 调整情况的公告	公司官网、证券时报	2018-03-29
13	创金合信量化多因子股票型 证券投资基金2017年年度报 告	公司官网、证券时报	2018-03-31
14	创金合信量化多因子股票型 证券投资基金2017年年度报 告摘要	公司官网、证券时报	2018-03-31
15	创金合信量化多因子股票型 证券投资基金2018年第1季 度报告	公司官网、证券时报	2018-04-19
16	创金合信基金管理有限公司 关于公司旗下部分基金估值 调整情况的公告	公司官网、证券时报	2018-04-27
17	创金合信基金管理有限公司 关于旗下部分开放式基金增 加代销机构的公告	公司官网、证券时报	2018-05-17
18	创金合信基金管理有限公司 关于旗下开放式基金参与银 河证券费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2018-05-18
19	创金合信基金管理有限公司 关于旗下开放式基金参与第 一创业证券费率优惠活动的 公告	公司官网、证券时报	2018-05-24
20	创金合信量化多因子股票型 证券投资基金变更业绩比较 基准并修改基金合同的公告	公司官网、证券时报	2018-06-07
21	创金合信量化多因子股票型 证券投资基金基金合同（20 18年6月修订）	公司官网、证券时报	2018-06-07
22	创金合信基金管理有限公司 关于旗下部分开放式基金增	公司官网、证券时报	2018-06-29

	加恒泰证券为代销机构的公告		
--	---------------	--	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

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2018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层

12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

二〇一八年八月二十九日