

(上接 D63 版)

官方网址: www.chinastock.com.cn
(34)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:韩志谦
联系人:王怀春
联系电话:0991-2307105
客服电话:400-800-0562
官方网址: www.hysec.com
(35)申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系人:李玉婷
联系电话:021-33388229
客服电话:4008895523
官方网址: www.swhyc.com
(36)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层28层A02单元
法定代表人:王连志
联系人:郑尚溢
联系电话:0755-82558038
客服电话:400-800-1001
官方网址: www.essence.com.cn
(37)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:南京市江东中路228号
法定代表人:周易
联系人:庞晓芸
客服电话:95597
官方网址: www.htsc.com.cn
(38)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闻路1508号
办公地址:上海市静安区新闻路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:李晔哲
客服电话:95525
官方网址: http://www.ebscn.com/
(39)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:詹露阳
联系人:石静武
联系电话:95511-8
官方网址: stock.pingan.com
(40)东莞证券股份有限公司
注册地址:东莞莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址:东莞莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:陈照星
联系人:李荣
客服电话:95328
官方网址: www.dgzq.com.cn
(41)中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市市中区经七路86号
办公地址:上海市花园石桥路66号东亚银行金融大厦18层
法定代表人:李玮
联系人:秦雨晴
客服电话:95538
官方网址: www.zts.com.cn
(42)第一创业证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人:刘学民
联系人:毛诗莉
联系电话:0755-23838750
客服电话:400-888-1888
官方网址: www.fcsc.com
(43)上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址:上海市黄浦区南京西路399号明天广场20楼
法定代表人:陈灿辉
联系人:徐璐
客服电话:400-820-5999
官方网址: www.shhxzq.com
(44)中投证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋11层18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A座4层、18-21层
法定代表人:高涛
联系人:万玉琳
客服电话:95532
官方网址: www.china-invs.cn
(45)永鑫保险销售服务有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世博馆路200号3层A区
办公地址:上海浦东新区世博馆路200号B栋3层
法定代表人:单开
联系人:曹楠
客服电话:95552
官方网址: www.all-share.com.cn
(46)深圳前海微众银行股份有限公司
注册地址:深圳前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座
法定代表人:顾敏
联系人:张瑜
客服电话:400-999-8800
官方网址: www.webank.com
(47)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
法定代表人:姜昧军
联系人:王雯
客服电话:400-832-3000
官方网址: www.csc.com.cn
(48)包商银行股份有限公司
注册地址:内蒙古包头市钢铁大街6号
办公地址:内蒙古包头市钢铁大街6号
法定代表人:李镇西
联系人:刘芳
客服电话:95352
官方网址: www.bsb.com.cn
(49)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号310室

办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3楼
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
客服电话:400-166-6788
官方网址: www.66zichan.com
(50)国金证券股份有限公司
注册地址:成都市青羊区东城根上街95号
办公地址:成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:刘婧滢
客服电话:95310
官方网址: www.gjzq.com.cn
(51)南京苏宁基金销售有限公司
办公地址:南京玄武区苏宁大道1号
注册地址:南京玄武区苏宁大道1号
法定代表人:刘汉青
联系人:刘汉青
客服电话:95177
官方网址: www.snjijin.com
(52)平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市深南东路5047号
办公地址:广东省深圳市深南东路5047号
法定代表人:孙建一
联系人:赵杨
客服电话:95511-3
官方网址: bank.pingan.com
(53)广发期货有限公司
注册地址:广东省广州市黄埔区峻弦街12号1002房
办公地址:广州市天河区体育西路红盾大厦15楼
法定代表人:罗满生
联系人:袁克璇
客服电话:95105826
官方网址: web.gfqh.com.cn/front/index.jhtml
(54)济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
客服电话:400-673-7010
官方网址: www.jianfortune.com
(55)上海量基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高路路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张跃伟
联系人:党敏
联系电话:021-20691935
客服电话:400-820-2899
官方网址: www.erichfund.com
(56)和耕传承基金销售有限公司
注册地址:郑州市郑东新区东风路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号院国际电子城b座
法定代表人:李淑慧
联系人:董亚芳
联系电话:13810222517
客服电话:4000-555-671
官方网址: www.hggcpc.com
(57)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江江西路5号广州国际金融中心主塔19、20层
办公地址:广州市天河区珠江江西路5号广州国际金融中心主塔19、20层
法定代表人:胡伏云
联系人:梁薇
客服电话:95396
官方网址: www.gzs.com.cn
(58)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座
办公地址:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座
法定代表人:庞介民
客服电话:440-196-6188
官方网址: www.cnht.com.cn
二、登记机构
名称:创金合信基金管理有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号201室
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层
法定代表人:刘学民
电话:0755-23838000
传真:0755-82737441-0187
联系人:吉祥
三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:安冬、陆奇
联系人:安冬
四、审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
电话:021-2323 8888
传真:021-2323 8800
联系人:边晓红
经办注册会计师:曹翠丽、边晓红

第四部分 基金的名称

创金合信量化核心混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型

混合型证券投资基金

第六部分 基金的投资目标

在控制风险的同时,追求超越业绩比较基准的投资回报。

第七部分 基金的投资方向

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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金可将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例为60%至95%。每个交易日日终,在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

第八部分 基金投资策略

1. 资产配置策略

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。

2. 股票投资策略

在经济发展的不同阶段,各领域的优质公司大都盈利能力稳定,具备较高的市场占有率和市场影响力,相对而言更容易获取资源,其可以充分分享经济增长的果实,进而将其转化为企业自身的业绩增长动力,是经济增长的核心力量,也是资本市场中的核心代表。本基金在资产配置基础上,致力于通过定量方法系统性地挖掘这一类股票的投资机会。

本基金股票投资组合的构建以多因子模型为基础框架,并根据预先设定的风险预算、交易成本、投资限制等时机情况的需要进行组合优化。即,本基金股票组合的构建包括多因子模型和投资组合优化两个部分。

(1) 多因子模型

多因子模型是一套通用的定量分析框架。在这一框架下,股票收益可分解为一系列因子收益及权重的组合。多因子模型致力于寻找持续稳定的超额收益因子,并进而根据因子收益的预测,形成股票超额收益的预测结果。本基金根据国内证券市场的实际情况,在实证检验的基础上,寻找适合国内市场的因子组合。本基金所采用的多因子模型主要运用包括价值、质量、动量、市场预期等类型的基本因子,并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论,对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上,基金管理人将根据市场环境的变化,综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判,适时调整各因子类别的具体组合及权重。

(2) 投资组合优化模型

在形成股票投资组合的具体结构时,本基金将采取基于风险预算框架,结合交易成本控制的投资组合优化模型。具体而言,根据多因子模型的超额收益预测结果,基金管理人将综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素,通过主动投资组合优化器,构建风险调整后的最优投资组合。

3. 固定收益类品种投资策略

(1) 债券投资策略

本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利率差动策略等多种积极管理策略,通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会,构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

(2) 中小企业私募债投资策略

本基金在控制信用风险的基础上,采取分散化投资方式进行中小企业私募债的投资。基金管理人将紧密跟踪研究企业基本面情况,适时调整组合,控制投资风险。

(3) 资产支持证券投资

本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资框架进行资产支持证券投资。其中,自上而下投资策略指在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上,运用定量或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析,对收益率走势及其收益和风险进行判断;自下而上投资策略指运用定量或定性分析方法对资产信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。

4. 衍生品投资策略

(1) 权证投资策略。权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

(2) 股指期货、股票期权合约投资策略。本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约、股票期权合约进行交易,以降低股票仓位调整的交易成本,提高投资效率,从而更好地实现投资目标。基金管理人将根据审慎原则,建立期权交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项,以防范股票期权投资的风险。

(3) 本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况,如法律法规或监管机构允许基金投资前述衍生工具,本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定,制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策,在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上,谨慎地进行投资。

5. 其他

未来,随着市场的发展和基金管理运作的需要,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,遵循法律法规的规定,相应调整或更新投资策略,并在招募说明书更新中公告。

第九部分 基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率×80%+中债综合财富(总值)指数收益率×20%

本基金选定被市场广泛认同的沪深300指数作为股票部分的业绩比较基准,选定能够反映债券市场总体走势的中债综合财富(总值)指数作为固定收益部分的业绩比较基准。此外,本基金还参考预期的大类资产配置比例设置了业绩比较基准的权重。

如果指数编制单位停止计算编制以上指数或更改指数名称,或今后法律法规发生变化,或有更适当的、更能作为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,调整基金的业绩比较基准,但在取得基金托管人同意后报中国证监会备案,并及时公告,无须召开基金份额持有人大会审议。

第十部分 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。

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载内容不存在虚假记载、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法律责任。

本基金的托管人根据基金合同的规定,复核了本报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日(未经审计)。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	117,017,471.09	80.32
	其中:股票	117,017,471.09	80.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,725,460.00	4.62
	其中:债券	6,725,460.00	4.62
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,834,570.07	14.99
8	其他资产	117,020.19	0.08
9	合计	145,694,521.35	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农林、牧、渔业	237,959.00	0.17
B	采矿业	3,865,207.36	2.80
C	制造业	56,468,817.99	40.97
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	252,731.85	0.18
E	建筑业	3,831,614.00	2.78
F	批发和零售业	1,087,587.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	3,427,438.71	2.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,285,235.00	3.11
J	金融业	30,935,515.93	22.44
K	房地产业	8,065,338.25	5.85
L	租赁和商务服务业	2,216,293.00	1.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	159,320.00	0.12
O	国防军工、医药和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,812,227.00	1.31
S	综合	371,786.00	0.27
	合计	117,017,471.09	84.90

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

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	601318	中国平安	155,704	9,121,257.48	6.62
2	600519	贵州茅台	10,400	7,607,184.00	5.52
3	000651	格力电器	120,900	5,700,435.00	4.14
4	000858	五粮液	57,201	4,347,276.00	3.15
5	600016	民生银行	515,700	3,609,900.00	2.62
6	002415	海康威视	87,400	3,245,162.00	2.35
7	600036	招商银行	115,800	3,061,752.00	2.22
8	600104	上汽集团	74,629	2,611,268.71	1.89
9	601288	农业银行	707,900	2,435,176.00	1.77
10	600085	海澜之家	72,539	2,426,605.72	1.76

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,725,460.00	4.88
	其中:政策性金融债	6,725,460.00	4.88
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,725,460.00	4.88

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018065	国开1701	67,000	6,725,460.00	4.88

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

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。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

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. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排

的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1 2017年7月26日,珠海格力电器股份有限公司(以下简称“格力电器”)公告收到中国证券监督管理委员会广东监管局(以下简称“广东监管局”)对其公司董事会自发下达的行政监管措施决定书《关于对徐自发自采取出具警示函措施的决定》。原因是:徐自发自2016年11月24日,通过交易所集中竞价交易的方式买入格力电器股票575,300股,成交均价为26.39元/股,成交金额1518.22万元。2017年5月22日,徐自发自再次通过交易所集中竞价交易的方式,卖出格力电器股票400,825股,成交均价为33.45元/股,成交金额1340.76万元。徐自发自作为格力电器的董事,将持有的格力电器股票在买入后不足6个月卖出,违反了《证券法》第四十七条的规定,并被广东监管局采取出具警示函的监管措施。

2017年10月19日,格力电器公告收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《调查通知书》(编号:粤证调查通字170202号),该通知书内容为:因涉嫌违反证券法律法规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,我会决定对你立案调查,予以配合”。

本基金投研人员分析认为,上述行政监管对公司经营并无实质性影响,格力电器改正态度积极,迅速做出反应,积极配合中国证监会的调查工作,并严格按照相关要求履行信息披露义务。该事件发生后该公司经营状况正常,该公司作为沪深300指数的重要成分股,目前估值和财务状况均良好。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格力电器进行了投资。

11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的

备选股票库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,985.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	63,300.60
5	应收申购款	4,734.23
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	117,020.19

11.4 报告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。

11.5 报告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。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。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。

本基金合同生效日为2017年3月27日,基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

阶段	净值增长率①	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
2017.03.27-2017.12.31	12.36%	0.53%	12.46%	0.54%	-0.10%	-0.01%
2018.01.01-2018.06.30	-6.21%	1.07%	-9.65%	0.92%	3.44%	0.15%

阶段	净值增长率①	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
2017.03.27-2017.12.31	11.46%	0.53%	12.46%	0.54%	-1.00%	-0.01%
2018.01.01-2018.06.30	-6.65%	1.07%	-9.65%	0.92%	3.00%	0.15%

第十三部分 费用概览

一、基金运作费用

(一)基金费用的种类

- 基金管理人的管理费;
- 基金托管人的托管费;
- C类基金份额的销售服务费;
- 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
- 基金份额持有人大会费用;
- 基金的证券、期货交易费用;
- 基金的资金汇划费用;
- 基金的相关账户开户费用、账户维护费用;
- 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%费率计提。管理费的计算方法如下:
 $H = E \times 1.50\% \times \text{当年天数}$
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。

2. 基金托管人的托管费

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:
 $H = E \times 0.25\% \times \text{$