创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信量化发现混合	
基金主代码	003241	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年09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	523,692,845.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信量化发现混合A	创金合信量化发现混合C
下属分级基金的交易代码	003241	003242
报告期末下属分级基金的份额总额	357,068,285.15份	166,624,560.49份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用数量化投资模型指导资产配置和股票选择决策，力争持续获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的方式，以宏观经济数据、上市公司相关数据、资本/资金市场相关数据为研究与分析对象，建立数量化投资模型，指导资产配置和股票选择决策，一方面，本基金基于对投本市场参与主体行为趋势的研究，从“自上而下”的角度进行资产配置；另一方面，本基金采用量化选股模型，从与上市公司相关的数据中发现有价值的信息，以“自下而上”的视角精选股票投资组合。
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%＋银行人民币活期存款利率（税后）×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货币市场基金、债券型基金，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	010-66106798
	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

2.4 信息披露方式

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	深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	创金合信量化发现混合A	创金合信量化发现混合C
本期已实现收益	-34,093,406.35	-16,124,638.39
本期利润	-40,271,462.31	-18,882,838.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0976	-0.1041
本期基金份额净值增长率	-11.64%	-11.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.1697	-0.1819
期末基金资产净值	296,481,425.39	136,314,320.02
期末基金份额净值	0.8303	0.8181

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。

3.2 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

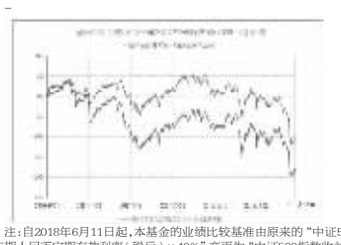
创金合信量化发现混合A

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
过去一个月	-7.72%	1.53%	-7.18%	1.46%	-0.54%	0.07%
过去三个月	-10.04%	1.16%	-10.36%	0.99%	0.32%	0.17%
过去六个月	-11.64%	1.18%	-11.26%	0.95%	-0.38%	0.23%
过去一年	-9.09%	0.96%	-9.89%	0.78%	0.80%	0.18%
自基金合同生效起至今	-16.97%	0.85%	-10.22%	0.68%	-6.75%	0.17%

创金合信量化发现混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.78%	1.53%	-7.18%	1.46%	-0.60%	0.07%
过去三个月	-10.23%	1.16%	-10.36%	0.99%	0.13%	0.17%
过去六个月	-11.99%	1.18%	-11.26%	0.95%	-0.73%	0.23%
过去一年	-9.81%	0.96%	-9.89%	0.78%	0.08%	0.18%
自基金合同生效起至今	-18.19%	0.85%	-10.22%	0.68%	-7.97%	0.17%

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×60%＋一年期人民币定期存款利率（税后）×40%”变更为“中证500指数收益率×80%＋银行人民币活期存款利率（税后）×20%”。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	2016-09-27	-	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月加入国寿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。

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遵规守信情况的说明

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46次，该基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因为：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发现混合A基金份额净值为0.8303元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.64%，同期业绩比较基准收益率为-11.26%；截至报告期末创金合信量化发现混合C基金份额净值为0.8181元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.99%，同期业绩比较基准收益率为-11.26%。

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 管理人对报告期内本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

本基金本报告期末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发现灵活配置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，创金合信量化发现灵活配置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发现灵活配置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。本报告期内，创金合信量化发现灵活配置混合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发现灵活配置混合型证券投资基金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：创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产：		
银行存款	35,098,908.01	46,307,172.15
结算备付金	59,431,545.52	64,505,632.43
存出保证金	8,068,801.91	9,431,470.88
交易性金融资产	333,515,573.99	533,347,514.60
其中：股票投资	322,550,925.99	531,697,815.40
基金投资	-	-
债券投资	10,964,648.00	1,649,699.20
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	2,681,708.61	3,670,609.12
应收利息	343,891.55	28,556.55
应收股利	-	-
应收申购款	7,069.19	12,266.68
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	439,147,498.78	657,303,222.41
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,352,047.51	7,856,201.84
应付赎回款	414,513.25	677,287.61
应付管理人报酬	561,297.49	845,566.82
应付托管费	93,549.58	140,927.81
应付销售服务费	94,028.33	133,722.50
应交税费	1,738,057.06	1,944,091.07
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	98,260.15	209,000.00
负债合计	6,351,753.37	11,806,797.65
所有者权益：		
实收基金	523,692,845.64	639,146,076.84
未分配利润	-90,897,100.23	-43,649,652.08
所有者权益合计	432,795,745.41	645,496,424.76
负债和所有者权益总计	439,147,498.78	657,303,222.41

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额总额523,692,845.64份，其中下属A类基金份额357,068,285.15份，C类基金份额166,624,560.49份。下属A类基金份额净值0.8303元，C类基金份额净值0.8181元。

6.2 利润表

会计主体：创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入	-43,331,664.59	-66,026,406.02
1.利息收入	774,985.30	2,248,493.10
其中：存款利息收入	711,602.19	434,984.15
债券利息收入	63,383.11	586,520.91
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	1,226,988.04
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-35,201,561.13	-112,657,022.04
其中：股票投资收益	-36,697,324.33	-108,197,734.51
基金投资收益	-	-
债券投资收益	48,586.82	65,264.31
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-1,081,700.39	-9,867,480.00
股利收益	2,528,876.77	5,342,928.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-8,936,256.98	44,008,306.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	31,168.22	373,816.46
减：二、费用	15,822,636.13	22,612,819.52
1. 管理人报酬	4,027,376.95	8,057,005.38
2. 托管费	671,229.52	1,342,834.21
3. 销售服务费	648,914.51	1,527,936.63
4. 交易费用	10,363,987.32	11,575,476.80
5. 利息支出	918.25	723.54
其中：卖出回购金融资产支出	918.25	723.54
6. 税金及附加	2,009.12	-
7. 其他费用	108,200.46	108,842.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-59,154,300.72	-88,639,225.54
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-59,154,300.72	-88,639,225.54

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金

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)	639,146,076.84	-43,649,652.08	645,496,424.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-59,154,300.72	-59,154,300.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-165,453,231.20	11,906,852.57	-153,546,378.63
其中：1.基金申购款	17,342,168.51	-1,196,670.47	16,145,498.04
2.基金赎回款	-182,795,399.71	13,103,523.04	-169,691,876.67
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）	523,692,845.64	-90,897,100.23	432,795,745.41
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)	1,307,963,127.28	-13,346,025.34	1,294,617,101.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-88,639,225.54	-88,639,225.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-323,003,383.76	14,487,108.59	-308,516,275.17
其中：1.基金申购款	32,286,297.16	-1,047,395.80	31,238,901.36
2.基金赎回款	-355,289,680.92	15,534,504.39	-339,755,176.53
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）	984,959,743.52	-87,498,142.29	897,461,601.23

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	黄超眠	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

创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1878号《关于准予创金合信量化发现灵活配置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《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,511,939,991.40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1257号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,512,800,096.21份基金份额，其中认购资金利息折合860,094.81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《创金合信量化发现灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他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×60%＋一年期人民币定期存款利率(税后)×40%。根据本基金的基金管理人于2018年6月7日发布的《创金合信量化发现灵活配置混合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500指数收益率×80%＋银行人民币活期存款利率(税后)×20%。

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税 。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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	399,233,599.26	3.66%	-	-

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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	128,240.35	3.32%	-	-
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

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

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管理费	4,027,376.95	8,057,005.38
其中：支付销售机构的客户维护费	2,693,679.91	4,602,469.36

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×1.50%－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。

6.4.8.2.2 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	671,229.52	1,342,834.21

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×0.25%－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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.2.3 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		
	创金合信量化发现混合A	创金合信量化发现混合C	合计
创金合信基金	0.00	149.75	149.75
第一创业证券	0.00	2,837.54	2,837.54
工商银行	0.00	352,654.78	352,654.78
合计	-	355,642.07	355,642.07
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		
	创金合信量化发现混合A	创金合信量化发现混合C	合计
创金合信基金	-	223,078.06	223,078.06
第一创业证券	-	11,461.72	11,461.72
工商银行	-	660,469.33	660,469.33
合计	-	895,009.11	895,009.11

本基金A类基金份额不收取销售服务费，仅就C类基金份额所代表的基金资产收取销售服务费。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0.80%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.80%－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3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等。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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 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	35,098,908.01	116,592.44	44,235,906.40	240,924.75

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 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。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

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	-

6.4.9.2 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
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项停牌	5.84	2018-07-17	5.26	612,600	3,644,182.60	3,577,584.00	-
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大事项停牌	6.00	-	-	404,000	2,312,416.80	2,424,000.00	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事项停牌	9.49	-	-	101,900	969,982.00	967,031.00	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大事项停牌	10.80	2018-08-07	9.63	72,000	830,072.17	777,600.00	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	86,500	641,031.00	646,155.00	-
300008	天海防务	2018-06-19	重大事项停牌	4.81	2018-07-03	5.20	116,700	629,557.34	561,327.00	-
300187	永清环保	2018-04-09	重大事项停牌	9.32	-	-	53,600	515,686.94	499,552.00	-
600750	江中药业	2018-05-02	重大事项停牌	17.75	2018-08-01	16.12	24,468	428,296.12	434,307.00	-
600062	浙江广厦	2018-04-02	重大事项停牌	3.73	2018-07-30	3.90	90,700	325,481.36	338,311.00	-
603939	益丰药房	2018-04-17	重大事项停牌	59.72	2018-07-16	65.69	5,500	334,571.00	328,460.00	-
603636	南威软件	2018-05-29	重大事项停牌	10.00	-	-	30,900	315,920.19	309,000.00	-
002171	楚江新材	2018-06-07	重大事项停牌	6.78	-	-	44,100	290,436.95	298,998.00	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项停牌	32.50	-	-	8,900	291,728.00