创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2018年第2号)

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
截止日:2018年09月27日

重要提示

本基金经中国证监会2017年7月19日证监许可[2017]1258号文准予注册。本基金的基金合同于2017年9月27日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金,低于股票型基金。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,应全面了解本基金的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:与本基金投资金融衍生品、资产支持证券等特定品种相关的特定风险,如与投资金融衍生品相关的基差风险、保证金风险、第三方风险,以及与投资资产支持证券相关的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等;市场风险、基金资产的流动性风险;基金投资过程中产生的管理风险、运作风险和不可抗力风险。特别的,出于保护基金份额持有人的目的,本基金为保障基金资产组合的流动性与基金份额持有人的净赎回需求相适配,还将在特定环境下启动相应的流动性风险管理工具。敬请投资人详细阅读本招募说明书"风险揭示",以便全面了解本基金运作过程中的潜在风险。

基金不同于银行储蓄与债券,基金投资人有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

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。

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。

基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年9月27日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日(未经审计)。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

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(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15层

法定代表人:刘学民

成立日期:2014年7月9日

联系电话:0755-23838000

联系人:贾崇宝

组织形式:有限责任公司

注册资本:人民币1.7亿元

股权结构

股东名称	出资比例
第一创业证券股份有限公司	70%
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	30%
总计	100%

二、主要人员情况

1、董事会成员基本情况

公司董事会共有7名成员,其中1名董事长,3名董事,3名独立董事。

刘学民先生,董事长,研究生,国籍:中国。历任北京市计划委员会外经处副处长、北京京放经济发展公司总经理、佛山证券有限责任公司董事长,现任第一创业证券股份有限公司董事长、第一创业投资管理有限公司董事、深圳第一创业创新资本管理有限公司董事、国泰一新(北京)节水投资基金管理有限公司董事、深圳第一创业元创投资管理有限公司董事、北京第一创业圆创资本管理有限公司的董事、北京一创远航投资管理有限公司董事长、创金合信基金管理有限公司董事长、法定代表人。

苏彦祝先生,董事,硕士,国籍:中国。历任南方基金管理有限公司研究员、基金经理、投资部执行总监、投资部总监、第一创业证券股份有限公司副总裁兼资产管理部总经理,现任创金合信基金管理有限公司董事、总经理。

黄越岷先生,董事,硕士,国籍:中国。历任佛山市计量所工程师、佛山市诚信税务师事务所副经理、第一创业证券股份有限公司信息技术部总经理助理、清算托管部副总经理、资产管理部运营与客服负责人,现任创金合信基金管理有限公司董事、公司副总经理。

刘红霞女士,董事,本科,国籍:中国。历任广东省香江集团人力资源部副总经理、中国建材集团下属北新家居/易好家电器连锁有限公司人力资源总监、顺丰快递集团人事处总经理,现任第一创业证券股份有限公司副总裁、第一创业证券承销保荐有限责任公司监事,北京第一创业圆创资本管理有限公司董事长,深圳第一创业元创投资管理有限公司董事长,第一创业投资管理有限公司董事长、深圳第一创业创新资本管理有限公司董事长,深圳聚创文化产业投资管理有限公司董事长,深圳一创泰和投资管理有限公司董事长,深圳市一创创富投资管理有限公司执行董事,广东恒元创投资管理有限公司董事,珠海一创明昇投资管理有限公司董事长,深圳一创汇智股权投资管理有限公司法人代表、董事长,珠海一创众值大数据投资有限公司董事,中关村顺势一创(北京)投资管理股份有限公司法人代表、董事长,浙江一创电建资产管理有限公司董事,深圳市鲲鹏一创股权投资管理有限公司董事,上海金浦瓴岳投资管理有限公司董事,广东恒健新兴产业投资基金管理有限公司董事,颐创(上海)文化传媒有限公司,创金合信基金管理有限公司董事。

陈基华先生,独立董事,硕士,高级会计师,国籍:中国。历任中国诚信证券评估有限公司经理、红牛维他命饮料有限公司财务总监、ALJ(中国)有限公司财务总监、吉通网络通讯股份有限公司副总裁、财务总监、中国铝业股份有限公司执行董事、副总裁、财务总监、农银汇理基金管理有限公司董事、中铝海外控股有限公司总裁、中国太平洋保险(集团)有限公司副总裁,现任北京厚基资本管理有限公司总裁、中铁高新工业股份有限公司独立董事、江苏沃田集团董事、黄山永新股份有限公司、创金合信基金管理有限公司独立董事。

潘津良先生,独立董事,研究生,国籍:中国。于1970年12月-1975年3月服役;1975年4月起历任北京照相机总厂职工,北京经济学院劳动经济系教师,北京市西城区委办公室干部、副主任,北京市委办公厅副处长,北京市政府休改办调研处、研究室处长,建设银行信托投资公司房地产业务部总经理、海南代表处主任、海南建信投资管理有限公司总经理,信达信托投资公司总裁助理、总裁办主任兼基金部总经理,信达投资有限公司总裁助理兼总裁办主任,中润经济发展有限责任公司副总经理、总经理、董事长、党委委员、党委书记,名誉董事长。现任创金合信基金管理有限公司独立董事。

徐肇宏先生,独立董事,学士,国籍,中国。曾就职于北京市皮革工业公司、中国人民银行、中国工商银行,1999年12月-2015年5月历任中国华融资产管理公司人力资源部总经理、组织部部长,北京办事处总经理、党委书记,公司总裁助理、党委委员、副总裁。2011年1月-2013年1月任融德资产管理有限公司董事长、党委书记。现任创金合信基金管理有限独立董事。

2、监事基本情况

公司不设监事会,设监事一名、职工监事一名。

杨健先生,监事,博士,国籍:美国。历任华北电力设计院(北京)工程师,GE Energy(通用电气能源集团)工程师,ABB Inc.项目经理、新英格兰电力交易与调度中心首席分析师、通用电气能源投资公司助理副总裁、花旗集团高级副总裁,现任第一创业证券股份有限公司首席风险官、创金合信基金管理有限公司监事。

梁少珍女士,职工监事,国籍:中国。历任第一创业证券股份有限公司经纪业务部营销管理、东莞营业部运营总监、资产管理部综合运营主管。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司。

3、高级管理人员基本情况

刘学民先生,董事长、法定代表人,简历同前。

苏彦祝先生,总经理,简历同前。

梁绍锋先生,督察长,硕士,国籍:中国。历任中国国际贸易促进委员会深圳分会法务主管、世纪证券有限责任公司合规专员、第一创业证券股份有限公司法律合规部副总经理、现任创金合信基金管理有限公司督察长。

黄先智先生,副总经理,硕士,国籍:中国。历任湖南浏阳枫林花炮厂销售经理、第一创业证券股份有限公司资产管理部高级投资助理、固定收益部投资经理、资产管理部产品研发与创新业务部负责人兼交易部负责人。现任创金合信基金管理有限公司副总经理。

黄越岷先生,副总经理,简历同前。

刘逸心女士,副总经理,学士,国籍:中国。历任中国工商银行北京市分行个人金融业务部项目经理、上投摩根基金管理有限公司北京分公司北方区域渠道业务总监、第一创业证券股份有限公司资产管理部市场部负责人,现任创金合信基金管理有限公司副总经理。

张雪松先生,副总经理,博士,国籍:中国。历任广东发展银行深圳分行信贷员,深圳市太阳海岸国际旅游发展有限公司财务副经理,南方基金管理有限公司养老金及机构理财部总监助理、基金经理、养老金业务部总监、机构业务部总监,第一创业证券股份有限公司资产管理部私募业务战略规划组负责人,现任创金合信基金管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

陈玉辉先生,中国国籍,经济学硕士,2003年6月加入新疆证券有限责任公司,从事石化行业研究;2005年度获中央电视台、中国证券报联合评选的首届"全国十佳证券分析师"。2006年1月加入东方证券股份有限公司研究所,任化工行业研究员。2008年3月加入招商基金管理有限公司,历任研究部副总监、总监,并于2012年11月14日至2015年4月10日担任招商大盘蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2015年7月任创金合信基金管理有限公司投资一部总监、基金经理。

5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

苏彦祝先生,创金合信基金管理有限公司董事、总经理

陈玉辉先生,创金合信基金管理有限公司投资一部总监

曹春林先生,创金合信基金管理有限公司基金经理

王一兵先生,创金合信基金管理有限公司固定收益部总监

张荣先生,创金合信基金管理有限公司基金经理

薛静女士,创金合信基金管理有限公司总经理助理

程志田先生,创金合信基金管理有限公司量化投资部总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:易会满

注册资本:人民币35,640,625.71万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

二、主要人员情况

截至2018年6月,中国工商银行资产托管部共有员工212人,平均年龄33岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月,中国工商银行共托管证券投资基金874只。自2003 年以来,中国工商银行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

四、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来,各项业务飞速发展,始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得,是与资产托管部"一手抓业务拓展,一手抓内控建设"的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作,在积极拓展各项托管业务的同时,把加强风险防范和控制的力度,精心培育内控文化,完善风险控制机制,强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅,获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可,也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,保证托管资产的安全完整;维护持有人的权益;保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策,对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照"内控优先"的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。

(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5)有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6)独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为中国工商银行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。

(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立"自控防线"、"互控防线"、"监控防线"三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立"以人为本"的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制理念。

(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。

(5)内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控,指导业务部门进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施,排查风险隐患。

(6)数据安全控制。资产托管部通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7)应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战,资产托管部不断提高演练标准,从最初的按照预订时间演练发展到现在的"随机演练"。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2)完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查,其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

直销机构: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(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

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
传真:0755-82769149
电话:0755-23838923
邮箱:cjhxzhixiao@cjhxfund.com
联系人:欧小娟
网站:www.cjhxfund.com

2、其他销售机构

(1)中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京西城区复兴门内大街55号
法定代表人:易会满
联系人:杨菲
客户服务电话:95588
官方网址:www.icbc.com.cn

(2)兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路154号中山大厦
办公地址:福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
联系人:卞晸煜
客服电话:95561
官方网址:www.cib.com.cn

(3)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
联系人:邓炯鹏
客服电话:95555
官方网址:www.cmbchina.com

(4)珠海华润银行股份有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大九洲大道东1346号
办公地址:广东省珠海市吉大九洲大道东1346号
法定代表人:刘晓勇
联系人:李阳
客服电话:400-8800-338
官方网址:www.crbank.com.cn

(5)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

(6)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

(7)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38至45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38至45层
法定代表人:宫少林
联系人:黄婵君
联系电话:0755-82943666
客服电话:95565
官方网址:www.newone.com.cn

(8)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.firstcapital.com.cn

(9)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:许梦圆
联系电话:010-85156398
客服电话:95587
官方网址:www.csc108.com

(10)安信证券股份有限责任公司
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:郑向溢
联系电话:0755-82558038
客服电话:400-800-1001
官方网址:www.essence.com.cn

(11)长城证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层
法定代表人:丁益
联系人:金夏
联系电话:0755-83516289
客服电话:400-666-6888
官方网址:www.cgws.com

(12)银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈共炎
联系人:邓颜
联系电话:010-66568292
客服电话:400-888-8888
官方网址:www.chinastock.com.cn

(13)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
客服电话:95511-8
官方网址:stock.pingan.com

(14)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系人:周杨
客服电话:95536
官方网址:www.guosen.com.cn

(15)东莞证券股份有限公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址:东莞市莞城区可园南路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

(16)太平洋证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
办公地址:北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元
法定代表人:李长伟
联系人:马焱
客服电话:95397
官方网址:www.tpyzq.com

(17)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江西路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: 梁微
客服电话:95396
官方网址:www.gzs.com.cn

(18)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

(19)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.csco.com.cn

(20)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

(21)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

(22)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新匣路1508号
办公地址:上海市静安区新匣路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:刘晨
客服电话:95525
官方网址:www.ebscn.com

(23)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:刘婧漪
客服电话:95310
官方网址:www.gjzq.com.cn

(24)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号西裙楼4楼
法定代表人:胡学勤
联系人:宁博宇
客服电话:400-821-9031
官方网址:www.lufunds.com

(25)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址:深圳市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:深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法定代表人:高锋
联系人:廖嘉琦
客服电话:400-804-8688
官方网址:www.foreseakeynes.com

(26)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室
法定代表人:肖雯
联系人:邱湘湘
客服电话:020-89629066
官方网址:www.yingmi.cn

(27)深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人:赖任军
联系人:张烨
客服电话:400-930-0660
官方网址:www.jfzinv.com

(28)诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋
法定代表人:汪静波
联系人:朱了
客服电话:400-821-5399
官方网址:www.noah-fund.com

(29)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市文二西路1号903室
办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼
法定代表人:凌顺平
联系人:刘宁
客服电话:4008-773-772
官方网址:www.5ifund.com

(30)大泰金石基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人:袁顾明
联系人:王骅
客服电话:400-928-2266
官方网址:www.dtfunds.com

(31)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层
办公地址:上海徐汇区东湖路7号大公馆
法定代表人:其实
联系人:高莉莉
客服电话:95021/400-1818-188
官方网址:www.1234567.com.cn

(32)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
客服电话:400-678-8887
官方网址:www.zlfund.cn

(33)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人:马勇
联系人:文雯
客服电话:400-166-1188
官方网址:8.jrj.com.cn

(34)上海大智慧基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102/1103单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102/1103单元
法定代表人:申健
联系人:胡旦
客服电话:021-20292031
官方网址:www.wg.com.cn

(35)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人:杨文斌
联系人:王诗玙
客服电话:400-700-9665
官方网址:www.ehowbuy.com

(36)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
法定代表人:王伟刚
联系人:熊小满
客服电话:010-62680527
官方网址:www.hcjijin.com

(37)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市昆明路518号北美广场A1002-A1003室
法定代表人:王翔
联系人:吴鸿飞
客服电话:400-820-5369
官方网址:www.jiyufund.com.cn

(38)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
客服电话:4000-766-123
官方网址:www.fund123.cn

(39)北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人:胡伟
联系人:姜颖
客服电话:400-618-0707
官方网址:www.hongdianfund.com

(40)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷富
联系人:徐亚丹
客服电话:400-821-0203
官方网址:www.520fund.com.cn

(41)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部A座
法定代表人:江卉
联系人:徐伯宇
客服电话:95118
官方网址:jr.jd.com

(42)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号1002室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:刘洋
客服电话:010-85650628
官方网址:licaike.hexun.com

(43)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

(44)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区望京阜通东大街 望京SOHO T3 A座 19层
法定代表人:钟斐斐
联系人:戚晓强
客服电话:400-061-8518
官方网址:danjuanapp.com

(45)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室
法定代表人:张冠宇
联系人:刘美薇
客服电话:400-819-9868
官方网址:www.tdyhfund.com

(46)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
办公地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层
法定代表人:程刚
联系人:陈旭
客服电话:4000761166
官方网址:www.fengfd.com

(47)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
联系人:王哲宇
客服电话:400-643-3389
官方网址:www.vstonewealth.com

(48)上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:胡燕亮
联系人:李娟
客服电话:021-50810673
官方网址:www.wacaijijin.com

(49)天津万家财富资产管理有限公司
注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李修辞
联系人:王茜蕊
客服电话:010-59013825
官方网址:www.wanjiawealth.com

(50)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

(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
官方网站:www.snjijin.com

(52)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路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

(53)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东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间
办公地址:北京市朝阳区酉仙桥路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.hgccpb.com

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:深圳市福田中心区福华一路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

创金合信优选回报灵活配置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

本基金在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,追求基金资产净值的长期稳健增长。

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、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具(包括同业存单等)、金融衍生品(包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,本基金可将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%-95%。每个交易日日终,在扣除股指期货、股票期权、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应持有不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,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

在大类资产配置上,本基金将通过对宏观经济环境、财政政策、货币政策、产业政策的分析和预测,判断宏观经济所处的经济周期及运行趋势,结合对资金供求状况、股票债券市场的估值水平以及市场情绪的分析,评估各类别资产的风险收益特征,并加以分析比较,采用定性和定量相结合的方法,形成对不同类别资产表现的预测,确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等资产类别间的配置比例。

本基金将密切关注市场整体风险的变化以及各类别资产的风险收益的相对变化趋势,在严格控制基金风险敞口的前提下,根据敞口大小和资产风险水平动态调整各大类资产之间的配置比例,力争提高基金收益。

2、股票投资策略

本基金将采取"自下而上"的研究框架,结合公司基本面、估值水平、市场比较等多种分析维度,综合运用定性分析与定量分析的方法,精选优质个股,构建股票投资组合。

(1)投资机会与选股策略

本基金将采取定性分析的方法,从上市公司的业绩质量、成长性、行业脉络等多方面入手,进行深入的分析和调查研究。重点投资于满足以下标准的公司:公司经营稳健,盈利能力较强或具有较好的盈利预期;公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明、执行力强。在深入研究基本面的基础上,坚持价值投资理念。

在投资机会分析的基础上,本基金将采取定量分析的方法,根据上市公司的行业特性及公司本身的特点,选择合适的股票估值方法,优先投资于具备显著投资价值的股票。可供选择的估值方法包括市盈率法(P/E)、市净率法(P/B)、市盈率-长期成长法(PEG)、企业价值/销售收入(EV/SALES)、企业价值/息税折旧摊销前利润法(EV/EBITDA)、自由现金流贴现模型(FCFF,FCFE)或股利贴现模型(DDM)等。

(2)股票组合的构建与调整

本基金根据前述资产配置策略,结合公司基本面分析和估值水平分析,精选具有持续成长潜力且估值相对合理的上市公司建立股票投资组合。当行业、公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时,本基金将适时对股票投资组合进行调整。

3、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、利差轮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。

4、资产支持证券投资策略

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池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配置。

5、可转换债券及可交换债券投资策略

可转换债券及可交换债券同时具有债券、股票和期权的相关特性,结合了股票的长期增长潜力和债券的相对安全、收益固定的优势,并有利于从资产整体配置上分散利率风险并提高收益水平。本基金将重点从可转换债券及可交换债券的内在债券价值(如票面利息、利息补偿及无条件回售价格)、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础股票的质地和成长性、基础股票的流通性等方面进行研究,充分发掘投资价值,并积极寻找各种套利机会,以获取更高的投资收益。

6、金融衍生品投资策略

(1)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。

(2)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。

(3)国债期货合约投资策略

为更好地管理投资组合的利率风险、改善组合的风险收益特性,本基金将本着谨慎的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,参与国债期货的投资。

(4)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其他衍生工具,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。

7、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

本基金的业绩比较基准为:

沪深300指数收益率*30%+中债综合指数收益率*70%

本基金为混合基金。在充分考虑本基金资产配置特点和股票组合构建原则,并对市场上主要股票、债券指数的编制方案与历史表现进行考察的基础上,本基金选择市场广泛认同的沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准、选择中债综合指数作为本基金债券组合的业绩基准,同时参照本基金的资产配置中枢设定了股票业绩基准、债券业绩基准的相对权重。其中,沪深300指数由中证指数有限公司编制,指数样本覆盖了沪深市场自由流通市值最大、流动性最好的300只股票;中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,反映了境内人民币债券市场的整体走势。本基金管理人认为,选用上述业绩比较基准在当前市场能够反映本基金的风险收益特征。

如果今后上述基准指数停止计算编制或更改名称,或法律法规发生变化,或有更适当的、更能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时,本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,依据维护投资者合法权益的原则,在按照监管部门要求履行适当程序并取得基金托管人同意后调整基金的业绩比较基准,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,其预期风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金,低于股票型基金。

第十一部分 基金投资组合报告(未经审计)

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	93,766,692.14	23.10
	其中:股票	93,766,692.14	23.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	160,000,000.00	39.43
	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	151,856,357.71	37.42
8	其他资产	209,577.81	0.05
9	合计	405,832,627.66	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	48,149,862.53	11.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,984,500.32	3.21
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,832,286.50	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	10,041,088.60	2.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	2,538,000.00	0.63
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
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	12,454,528.05	3.08
S	综合	1,685,200.00	0.42
	合计	93,766,692.14	23.20

3、报告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

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	600509	天富能源	2,888,801	12,912,940.47	3.20
2	600757	长江传媒	2,188,845	12,454,528.05	3.08
3	000521	美菱电器	2,088,802	8,020,999.68	1.99
4	600731	湖南海利	1,468,000	7,281,280.00	1.80
5	601333	广深铁路	1,400,000	5,950,000.00	1.47
6	600861	北京城乡	848,950	5,832,286.50	1.44
7	000698	沈阳化工	1,088,867	4,660,350.76	1.15
8	600089	特变电工	648,705	4,495,525.65	1.11
9	000778	新兴铸管	1,039,947	4,450,973.16	1.10
10	600192	长城电工	888,805	4,141,831.30	1.03

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告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。

7、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、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

本基金本报告期末投资股指期货。

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 长江出版传媒股份有限公司(以下简称"长江传媒")于2017年8月3日收到湖北证监局《关于对长江出版传媒股份有限公司采取出具警示函措施的决定》(中国证券监督管理委员会湖北监管局行政监管措施决定书[2017]19号)(以下简称"《决定书》"),在监管中发现公司存在以下违规事实:2015年6月8日,你公司全资子公司武汉德锦投资有限责任公司与公司部分关联自然人共同出资成立武汉丰荟股权投资基金合伙企业,该关联交易未及时履行相应的审议程序和信息披露义务,直至2017年6月2日才追加了相应的审议程序并予以披露。你公司的上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第四十八条的规定。

本基金投研人员分析认为,在受到处罚后,长江传媒立即回复将按照湖北省证监局的要求,严格加强关联关系及关联交易的识别,切实做好关联交易的信息披露工作。该事件发生后该公司经营状况正常,处罚对业绩影响无直接影响。该公司作为出版行业龙头之一,目前估值处于历史底部,维持持有评级。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长江传媒进行了投资。

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	82,452.01
2	应收证券清算款	136,548.39
3	应收股利	-
4	应收利息	-9,822.11
5	应收申购款	399.52
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	209,577.81

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9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	净值收益率①	净值收益率标准差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
2017.09.27-2017.12.31	0.15%	0.06%	0.86%	0.23%	-0.71%	-0.17%
2018.01.01-2018.06.30	-7.48%	0.39%	-2.44%	0.34%	-5.04%	0.05%

第十三部分 费用概览

一、基金运作费用

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《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;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券、期货交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、账户开户费用、账户维护费用;

9、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%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,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给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,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×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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述"基金费用的种类"中第3-9项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

二、基金销售费用

1、申购费率

本基金对通过基金管理人直销机构申购基金份额的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率,对通过直销机构申购基金份额的特定投资群体实施特定申购费率。特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金(包括企业年金单一计划以及集合计划),以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

(1)申购费率

投资者申购本基金基金份额的申购费率如下表所示:

申购金额	申购费率(其他投资者)	特定申购费率(特定投资群体)
100万元(不含)以下	1.2%	0.12%
100万元(含)-200万元(不含)	0.6%	0.06%
200万元(含)-500万元(不含)	0.2%	0.02%
500万元(含)以上	按笔固定收取1,000元/笔	

(2)在申购费按金额分档的情况下,如果投资者多次申购,申购费率适用单笔申购金额所对应的费率。

2、赎回费率

(1)赎回费率

本基金基金份额的赎回费率如下表所示:

持有时间	赎回费率
7日(不含)以下	1.50%
7日(含)-30日(不含)	0.75%
30日(含)-180日(不含)	0.50%
180日(含)-365日(不含)	0.25%
365日(含)以上	0

(2)投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。对持有期少于30日(不含)的持有人所收取赎回费用全额计入基金财产;对持有期在30日以上(含)且少于90日(不含) 的持有人所收取赎回费用总额的75%计入基金财产; 对持有期在90日以上(含)且少于180日(不含)的持有人所收取赎回费用总额的50%计入基金财产;对持有期在180日以上(含)且少于365日(不含)的持有人所收取的赎回费用总额的25%计入基金财产。赎回费未归入基金财产的部分用于支付市场推广、登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在《基金合同》规定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、申购费用由基金申购投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低申购费率和赎回费率。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同于2017年9月27日起生效,根据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《创金合信优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,结合本公司对本基金实施的投资管理活动,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

一、"重要提示"部分

更新了招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日。

二、"基金管理人"部分

1、更新了管理人的联系人。

2、更新了董事会成员的信息。

三、"基金托管人"部分

更新了基金托管人的信息。

四、"基金的投资"部分

更新了最新的"基金投资组合报告"。

五、"基金业绩"部分

更新了最新的"基金业绩"报告。

六、"基金份额持有人服务"部分

更新了基金份额持有人服务的内容。

七、"其他应披露事项"部分

根据相关公告的内容进行了更新。

创金合信基金管理有限公司
2018年11月9日