

中金纯债债券型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 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.....	9
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.....	11
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.....	13
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.....	13
§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.....	16
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.11 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
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的情况.....	39
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	42
§11 备查文件目录.....	42
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金纯债债券型证券投资基金	
基金简称	中金纯债	
基金主代码	000801	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 11 月 4 日	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	148,092,844.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中金纯债 A	中金纯债 C
下属分级基金的交易代码:	000801	000802
报告期末下属分级基金的份额总额	126,986,195.04 份	21,106,649.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金在对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策等研究的基础上，自上而下地决定债券组合久期、动态调整各类资产比例，结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析，优化债券组合的期限结构和类属配置。
业绩比较基准	中证全债指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

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	中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜季柳
	联系电话	010-63211122
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com
客户服务电话	(86) 400-868-1166	010-67595096
传真	(86) 010-66159121	010-66275853
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心

	17 层	
邮政编码	100032	100033
法定代表人	林寿康	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 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

基金级别	中金纯债 A	中金纯债 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,220,171.42	1,918,853.86
本期利润	9,664,927.23	2,053,581.27
加权平均基金份额本期利润	0.0325	0.0316
本期加权平均净值利润率	3.17%	3.10%
本期基金份额净值增长率	2.97%	2.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	4,429,267.94	665,720.56
期末可供分配基金份额利润	0.0349	0.0315
期末基金资产净值	132,155,862.57	21,895,257.83
期末基金份额净值	1.041	1.037
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	4.10%	3.70%

注：1、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；

2、本报告所列示的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；

3、期末可供分配利润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

中金纯债 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	-0.10%	0.10%	0.43%	0.04%	-0.53%	0.06%
过去三个月	2.06%	0.12%	2.21%	0.09%	-0.15%	0.03%
过去六个月	2.97%	0.12%	3.17%	0.09%	-0.20%	0.03%
自基金合同生效起至今	4.10%	0.11%	4.61%	0.12%	-0.51%	-0.01%

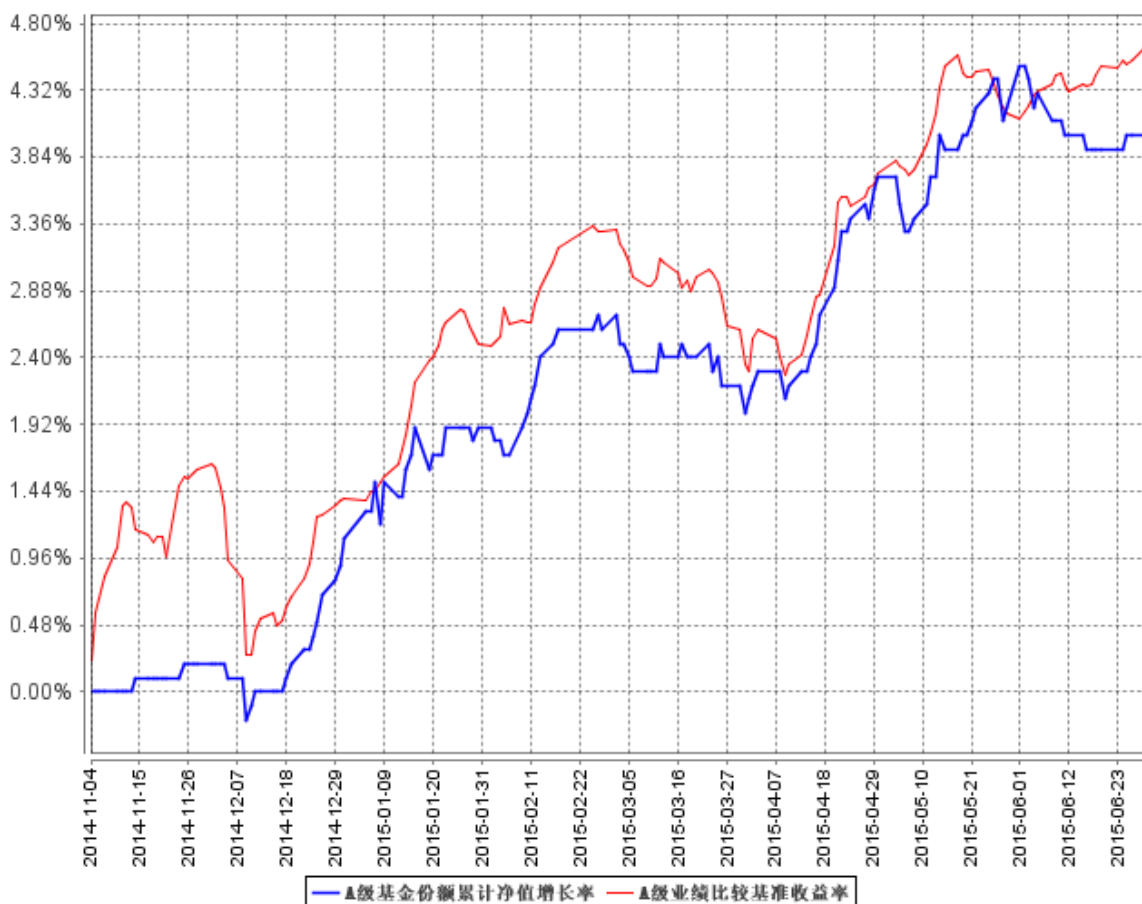
中金纯债 C

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	-0.19%	0.11%	0.43%	0.04%	-0.62%	0.07%
过去三个月	1.87%	0.12%	2.21%	0.09%	-0.34%	0.03%
过去六个月	2.67%	0.12%	3.17%	0.09%	-0.50%	0.03%
自基金合同生效起至今	3.70%	0.11%	4.61%	0.12%	-0.91%	-0.01%

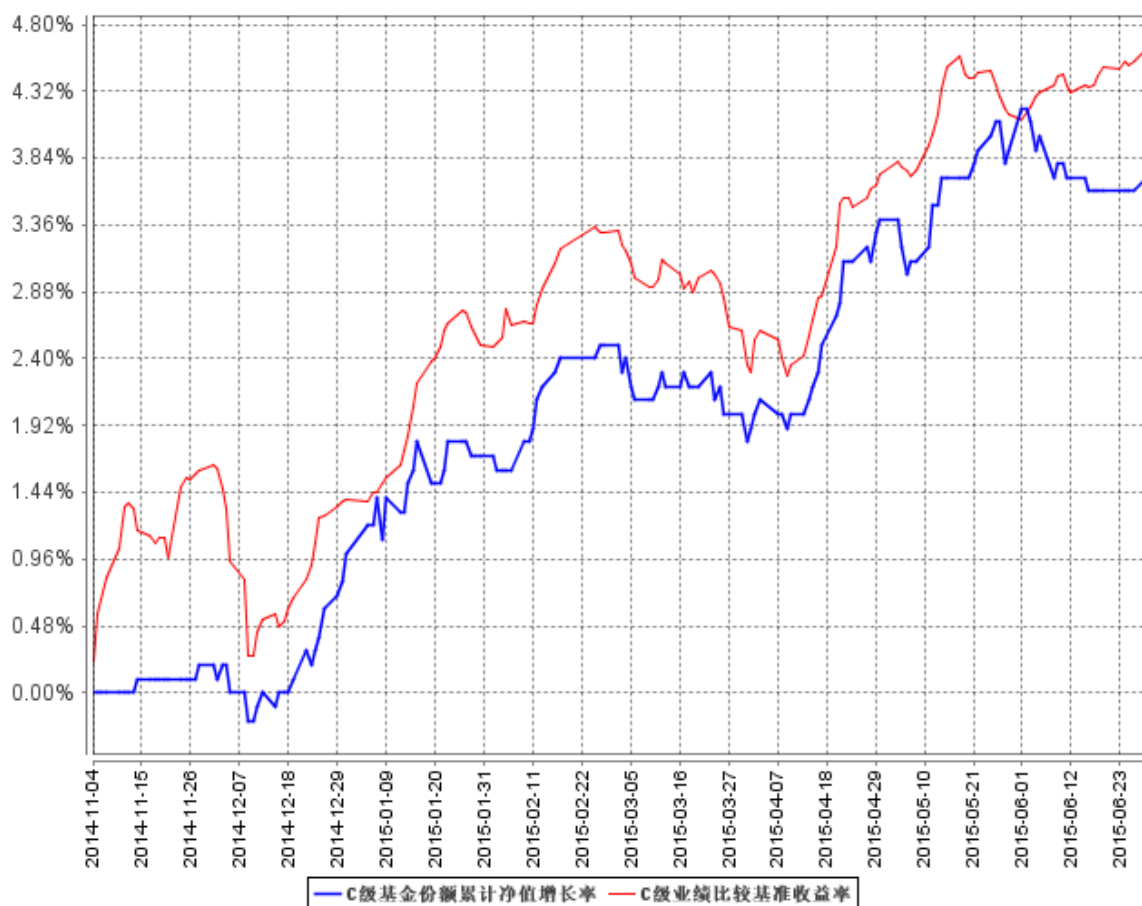
注：本基金的业绩比较基准为：中证全债指数。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2014 年 11 月 4 日。按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§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

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是证监会批准设立的第 90 家公募基金公司，也是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 1.5 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金管理有限公司注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层。公司目前拥有共同基金募集和

管理资格、特定客户资产管理业务资格。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下管理 4 支开放式基金--中金现金管家货币市场基金、中金纯债债券型证券投资基金、中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金和中金消费升级股票型证券投资基金，证券投资基金管理规模 30.21 亿。

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		
石云峰	本基金的基金经理	2014 年 11 月 4 日	-	8	石云峰先生，经济学硕士。历任中国邮政储蓄银行总行资金营运部交易员，太平养老保险股份有限公司固定收益投资经理，嘉实基金管理有限公司机构投资部投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理，2014 年 11 月 28 日起任中金现金管家货币市场基金基金经理。

注：1、任职日期说明：任职日期为基金合同生效日

2、证券从业年限的计算标准：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

3、本基金无基金经理助理

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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

上半年，国内经济依然面临较大的下行压力，货币政策对实体经济的传导较慢，宏观经济数据持续低于预期。不过，二季度宏观经济状况显示出企稳态势。工业增加值同比增速在 3 月下滑至 5.6%，达到 2008 年以来低点，4 月和 5 月则温和回升至 5.9% 和 6.1%。通胀数据维持低位，其中 CPI 同比数据较去年同期大幅下降，PPI 始终维持在 -4% 以下的水平，工业通缩趋势明显。

上半年货币政策总体延续适度宽松的基调。人民银行启用了包括下调存贷款利率、重启逆回购并下调公开市场回购利率、降低存款准备金率、续作中短期借贷便利等多种政策工具，积极引

导利率水平下行。

市场表现方面，虽然央行多次降准、降息，但受权益市场大幅上涨的影响，固定收益市场资金分流效应明显，且地方债置换不断影响市场情绪，报告期内债券市场收益率震荡下行。其中，利率债以震荡为主，高等级信用债收益率整体下行，而低等级信用债收益率则维持在相对高位。

报告期内本基金本着稳健投资原则，维持组合中等久期和杠杆，以中高等级信用债为主，为组合获取稳定回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，中金纯债 A 类份额净值增长率为 2.97%，中金纯债 C 类份额净值增长率为 2.67%，同期业绩比较基准收益率为 3.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为稳增长压力仍然很大，预计央行货币政策仍将适度宽松，中央可能会加大财政政策刺激力度。预计在这些政策的作用下，加上房地产销售出现了明显改善且地产行业融资出现加速态势，经济有望低位企稳。与此同时，通胀仍然会在低位运行，这也为货币政策持续宽松创造了条件。

我们预计，前期抑制债券市场走强的股市分流和地方债务置换等因素将逐步缓解，经济基本面将重新成为债市的主导因素。未来信用风险事件可能加速暴露，部分行业低等级产业债以及对周期性行业依赖较大、债务压力较大的信用债需要高度警惕。可转债市场由于可投资的标的已经很少，且正股波动幅度过大，吸引力有所下降。

本基金将继续本着稳健投资的原则，维持组合中等久期、中高等级信用债为主，平衡类属配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监督稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已

与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场和交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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：中金纯债债券型证券投资基金

报告截止日： 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	416,444.63	15,586,346.78
结算备付金		2,524,690.16	11,408,748.39
存出保证金		41,994.10	18,057.52
交易性金融资产	6.4.7.2	190,636,484.09	691,986,156.88
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		190,636,484.09	691,986,156.88
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	-	3,000,000.00
应收证券清算款		1,698,538.22	3,497,049.37
应收利息	6.4.7.5	4,732,651.03	11,690,410.61
应收股利		-	-
应收申购款		-	154,158.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		200,050,802.23	737,340,928.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 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		44,999,990.10	-
应付证券清算款		700.31	-
应付赎回款		665,030.48	14,832,140.47
应付管理人报酬		94,965.42	553,842.28
应付托管费		27,132.96	158,240.66
应付销售服务费		7,598.36	60,560.60
应付交易费用	6.4.7.7	1,375.00	3,359.85
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	202,889.20	8,730.46
负债合计		45,999,681.83	15,616,874.32
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	148,092,844.36	714,362,861.92
未分配利润	6.4.7.10	5,958,276.04	7,361,192.04
所有者权益合计		154,051,120.40	721,724,053.96
负债和所有者权益总计		200,050,802.23	737,340,928.28

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，中金纯债债券 A 基金份额净值 1.041 元，中金纯债债券 C 基金份额净值 1.037 元；中金纯债债券基金份额总额 148,092,844.36 份（其中 A 类 126,986,195.04 份，C 类 21,106,649.32 份）。

6.2 利润表

会计主体：中金纯债债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		15,024,571.55	
1.利息收入		11,627,802.45	
其中：存款利息收入	6.4.7.11	124,100.35	
债券利息收入		11,500,200.71	
资产支持证券利息收入		-	
买入返售金融资产收入		3,501.39	
其他利息收入		-	
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,698,224.34	
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	
基金投资收益		-	
债券投资收益	6.4.7.13	2,698,224.34	
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	
衍生工具收益	6.4.7.15	-	
股利收益	6.4.7.16	-	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	579,483.22	
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	119,061.54	
减：二、费用		3,306,063.05	
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,316,208.11	
2. 托管费	6.4.10.2.2	376,059.48	
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	135,260.28	

4. 交易费用	6.4.7.19	11,265.42	
5. 利息支出		1,246,751.11	
其中：卖出回购金融资产支出		1,246,751.11	
6. 其他费用	6.4.7.20	220,518.65	
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,718,508.50	
减：所得税费用		-	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,718,508.50	

注：本基金合同生效日为 2014 年 11 月 4 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金纯债债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 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）	714,362,861.92	7,361,192.04	721,724,053.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,718,508.50	11,718,508.50
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）	-566,270,017.56	-13,121,424.50	-579,391,442.06
其中：1.基金申购款	38,604,812.03	716,308.61	39,321,120.64
2.基金赎回款	-604,874,829.59	-13,837,733.11	-618,712,562.70
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）	148,092,844.36	5,958,276.04	154,051,120.40

注：本基金合同生效日为 2014 年 11 月 4 日，无上年度可比期间数据。

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：

<u> </u> 阚睿	<u> </u> 孙菁	<u> </u> 白娜
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

中金纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2014 年 8 月 19 日证监许可[2014]869 号文“关于准予中金纯债债券型证券投资基金注册的批复”的核准，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中金纯债债券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。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”），注册登记机构为中金基金。

本基金募集期为 2014 年 9 月 29 日至 2014 年 10 月 29 日。本基金于 2014 年 11 月 4 日成立，成立之日基金实收份额为 1,255,808,243.86 份（含利息转份额人民币 446,319.43 元），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》和《中金纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、公司债、企业债、可转换债券、中期票据、资产支持证券、短期融资券、债券回购和银行存款等固定收益类金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不直接买入股票、权证等权益类资产，仅可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持有股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产，应在其可交易之日起 30 个交易日内卖出。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，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：投资于债券类资产不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中证全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求编制。在具体会计核算和信息披露方面，同时亦按照证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度和半年度报告》（中国证监会正式稿）（2014 年 11 月 5 日）和中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》

编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

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以及中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况及自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金财务报表的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。本基金编制财务报表采用的货币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债包括交易性金融资产或金融负债-

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。衍生工具所产生的金融资产和金融负债在资产负债表中以衍生金融资产和衍生金融负债列示。

-应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

-其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于支付价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买

日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算确认。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日

确认。上述申购和赎回分别包括 A 类与 C 类基金份额之间转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 /（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益 /（损失）于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产利息收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。

根据《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。

根据《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

本基金的交易费用于交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期

内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字 [2007] 21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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 会计政策变更的说明

无

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

6.4.5.3 差错更正的说明

无

6.4.6 税项

根据财税字 [1998] 55 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2002] 128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (1) 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。
- (2) 基金买卖债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。
- (4) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	416,444.63
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	416,444.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	80,395,736.27	80,849,484.09	453,747.82
	银行间市场	108,063,152.68	109,787,000.00	1,723,847.32
	合计	188,458,888.95	190,636,484.09	2,177,595.14
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		188,458,888.95	190,636,484.09	2,177,595.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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 2015年6月30日
应收活期存款利息	100.76
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	1,136.66
应收债券利息	4,731,384.38
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	10.33
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	18.90
合计	4,732,651.03

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
----	-------------------

交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	1,375.00
合计	1,375.00

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	490.70
预提费用	202,398.50
合计	202,889.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中金纯债 A		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	562,321,253.05	562,321,253.05
本期申购	28,988,459.64	28,988,459.64
本期赎回(以“-”号填列)	-464,323,517.65	-464,323,517.65
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	126,986,195.04	126,986,195.04

金额单位：人民币元

中金纯债 C		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	152,041,608.87	152,041,608.87
本期申购	9,616,352.39	9,616,352.39
本期赎回(以“-”号填列)	-140,551,311.94	-140,551,311.94
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	21,106,649.32	21,106,649.32

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中金纯债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,372,509.34	2,532,797.94	5,905,307.28
本期利润	9,220,171.42	444,755.81	9,664,927.23
本期基金份额交易产生的变动数	-8,163,412.82	-2,237,154.16	-10,400,566.98
其中：基金申购款	388,881.27	192,083.74	580,965.01
基金赎回款	-8,552,294.09	-2,429,237.90	-10,981,531.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,429,267.94	740,399.59	5,169,667.53

单位：人民币元

中金纯债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	771,857.79	684,026.97	1,455,884.76
本期利润	1,918,853.86	134,727.41	2,053,581.27
本期基金份额交易产生的变动数	-2,024,991.09	-695,866.43	-2,720,857.52
其中：基金申购款	76,611.71	58,731.89	135,343.60
基金赎回款	-2,101,602.80	-754,598.32	-2,856,201.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	665,720.56	122,887.95	788,608.51

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,770.34
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	84,962.15
其他	367.86
合计	124,100.35

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期内无股票投资收益。

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 2015年1月1日至2015年6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	2,698,224.34
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	2,698,224.34

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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	875,900,624.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	856,482,742.78
减：应收利息总额	16,719,657.43
买卖债券差价收入	2,698,224.34

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末无投资其他衍生工具。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	579,483.22
——股票投资	-
——债券投资	579,483.22
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	579,483.22

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	119,061.54
合计	119,061.54

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	5,702.92
银行间市场交易费用	5,562.50
合计	11,265.42

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,767.52
帐户维护费	18,000.00
汇划手续费	9,120.15

合计	220,518.65
----	------------

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，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
中金基金管理有限公司（中金基金）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（中国建设银行）	基金托管人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（中金公司）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本报告期与上年度可比期间无关联方股票交易。

债券交易

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	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 成交总额的 比例
中金公司	660,570,950.75	100.00%	-	-

债券回购交易

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
中金公司	7,863,406,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期与上年度可比期间无关联方权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,316,208.11	-
其中：支付销售机构的客户维护费	832,910.74	-

注：1、支付基金管理人中金基金的管理人报酬按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值*0.7%/当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，本基金本报告期支付销售机构客户维护费832,910.74元，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用。

3、本基金合同生效日为2014年11月4日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	376,059.48	-

注：1、支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值*0.2%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2014 年 11 月 4 日，无上年度可比期间数据。

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中金纯债 A	中金纯债 C	合计
中金基金	-	2,201.35	-
中国建设银行	-	131,612.21	-
中金公司	-	1,115.21	-
合计	-	134,928.77	-

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日中金纯债 C 类基金资产净值的 0.4%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：中金纯债 C 类基金份额每日应计提的销售服务费=中金纯债 C 类基金份额前一日基金资产净值*0.4%/当年天数。

2、中金纯债 A 类基金份额不收取销售服务费。

3、本基金合同生效日为 2014 年 11 月 4 日，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末其他关联方未持有本基金。

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	416,444.63	38,770.34	-	-

注：1、本基金的活期存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金的结算备付金本报告期末余额为 2,524,690.16 元，当期利息收入为 84,962.15 元。

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在承销期内未参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 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

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
132002	15 天集 EB	2015 年 6 月 11 日	2015 年 7 月 2 日	新债未上市	100.00	100.00	2,240	224,000.00	224,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 44,999,990.10 元，于 2015 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。对于上述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对相应风险进行控制，从而控制风险，实现本基金的投资目标。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	-	120,477,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	20,042,000.00
合计	-	140,519,000.00

注：以上按短期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2 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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
AAA	65,389.50	12,063,152.40
AAA 以下	162,218,694.59	490,554,004.48
未评级	-	-
合计	162,284,084.09	502,617,156.88

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。本基金保持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，以备支付基金份额持有人的赎回款项。此外，本基金亦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。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。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

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6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	416,444.63	-	-	-	416,444.63
结算备付金	2,524,690.16	-	-	-	2,524,690.16

存出保证金	41,994.10	-	-	-	41,994.10
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	55,083,710.39	135,487,384.20	65,389.50	-	190,636,484.09
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,698,538.22	1,698,538.22
应收利息	-	-	-	4,732,651.03	4,732,651.03
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	58,066,839.28	135,487,384.20	65,389.50	6,431,189.25	200,050,802.23
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	44,999,990.10	-	-	-	44,999,990.10
应付证券清算款	-	-	-	700.31	700.31
应付赎回款	-	-	-	665,030.48	665,030.48
应付销售服务费	-	-	-	7,598.36	7,598.36
应付管理人报酬	-	-	-	94,965.42	94,965.42
应付托管费	-	-	-	27,132.96	27,132.96
应付交易费用	-	-	-	1,375.00	1,375.00
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	202,889.20	202,889.20
负债总计	44,999,990.10	-	-	999,691.73	45,999,681.83
利率敏感度缺口	13,066,849.18	135,487,384.20	65,389.50	5,431,497.52	154,051,120.40
上年度末 2014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	15,586,346.78	-	-	-	15,586,346.78
结算备付金	11,408,748.39	-	-	-	11,408,748.39
存出保证金	18,057.52	-	-	-	18,057.52
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	230,299,458.60	448,439,277.52	13,247,420.76	-	691,986,156.88
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	3,497,049.37	3,497,049.37
应收利息	-	-	-	11,690,410.61	11,690,410.61
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	154,158.73	-	-	-	154,158.73
资产总计	260,466,770.02	448,439,277.52	13,247,420.76	15,187,459.98	737,340,928.28
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	14,832,140.47	14,832,140.47
应付销售服务费	-	-	-	60,560.60	60,560.60
应付管理人报酬	-	-	-	553,842.28	553,842.28
应付托管费	-	-	-	158,240.66	158,240.66

应付交易费用	-	-	-	3,359.85	3,359.85
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	8,730.46	8,730.46
负债总计	-	-	-	15,616,874.32	15,616,874.32
利率敏感度缺口	260,466,770.02	448,439,277.52	13,247,420.76	-429,414.34	721,724,053.96

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	961,373.68	2,755,471.88
	市场利率上调 0.25%	-961,373.68	-2,755,471.88

6.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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。本基金本报告期末主要投资于证券交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有交易性权益类投资品种，因此无重大其他价格风险。

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 2015年6月30日		上年度末 2014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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	190,636,484.09	123.75	691,986,156.88	95.88
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	190,636,484.09	123.75	691,986,156.88	95.88

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	190,636,484.09	95.29
	其中：债券	190,636,484.09	95.29
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,941,134.79	1.47
7	其他各项资产	6,473,183.35	3.24
8	合计	200,050,802.23	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票资产。

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

本基金本报告期末未持有股票资产。

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

本基金本报告期内无股票交易。

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

本基金本报告期内无股票交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票交易。

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	8,024,400.00	5.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,328,000.00	13.20
	其中：政策性金融债	20,328,000.00	13.20
4	企业债券	100,866,694.59	65.48
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	61,352,000.00	39.83
7	可转债	65,389.50	0.04
8	其他	-	-
9	合计	190,636,484.09	123.75

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	150207	15 国开 07	200,000	20,328,000.00	13.20
2	122883	10 楚雄债	130,000	13,169,000.00	8.55
3	101455022	14 祁连山 MTN001	100,000	10,488,000.00	6.81
4	1180027	11 新奥企债	100,000	10,433,000.00	6.77
5	1280444	12 绍迪荡	100,000	10,359,000.00	6.72

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投资。

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投资。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 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	41,994.10
2	应收证券清算款	1,698,538.22
3	应收股利	-
4	应收利息	4,732,651.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,473,183.35

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票资产。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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
中金纯债 A	593	214,141.98	44,995,000.00	35.43%	81,991,195.04	64.57%
中金纯债 C	199	106,063.56	0.00	0.00%	21,106,649.32	100.00%
合计	792	186,985.91	44,995,000.00	30.38%	103,097,844.36	69.62%

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	中金纯债 A	3,254,345.64	2.56%
	中金纯债 C	33,054.18	0.16%
	合计	3,287,399.82	2.22%

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的情况

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	中金纯债 A	>100
	中金纯债 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中金纯债 A	0
	中金纯债 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金纯债 A	中金纯债 C
基金合同生效日（2014 年 11 月 4 日）基金 份额总额	1,053,652,047.95	202,156,195.91
本报告期期初基金份额总额	562,321,253.05	152,041,608.87
本报告期基金总申购份额	28,988,459.64	9,616,352.39
减：本报告期基金总赎回份额	464,323,517.65	140,551,311.94
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	126,986,195.04	21,106,649.32

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

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

本基金本报告期内管理人、托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在报告期内未受到稽查或处罚等情况。

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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金报告期内无新增或减少交易单元。

2、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设置满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特殊要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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	
	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
中金公司	660,570,950.75	100.00%	7,863,406,000.00	100.00%	-	-

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	关于中金基金管理有限公司新增平安银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年2月5日
2	关于新增北京展恒基金销售有限公司为销售机构并实施申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年2月10日
3	关于中金基金管理有限公司通过齐鲁证券代销网上费率优惠公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年3月12日
4	中金基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年3月27日
5	中金基金管理有限公司网上交易系统暂停服务公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年6月3日
6	中金基金管理有限公司关于建设银行电子银行系统升级的公告	中国证监会指定报刊及网站	2015年6月8日
7	中金基金管理有限公司关于网上直销身份认证系统升级的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年6月12日
8	中金基金管理有限公司关于网上直销开通招商银行借记卡支付的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年6月24日
9	中金基金管理有限公司关于建设银行电子银行系统升级的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年6月26日
10	中金基金管理有限公司关于建设银行电子银行系统升级的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015年7月3日

§11 备查文件目录**11.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会核准基金募集的文件
- 2、《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金纯债债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《中金纯债债券型证券投资基金招募说明书》

- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件，也可按工本费购买复印件。

中金基金管理有限公司
2015年8月26日