

创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金2016年年度报告

2016年12月31日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2017年3月27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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月22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。

本报告期自2016年01月07日起至12月31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	3
2.1	基金基本情况	3
2.2	基金产品说明	3
2.3	基金管理人和基金托管人	3
2.4	信息披露方式	3
2.5	其他相关资料	3
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	3
3.1	主要会计数据和财务指标	3
3.2	基金净值表现	3
3.3	过去三年基金的利润分配情况	3
§4	管理人报告	3
4.1	基金管理人及基金经理情况	3
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	3
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	3
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	3
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	3
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	3
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	3
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	3
§5	托管人报告	3
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	3
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	3
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	3
§6	审计报告	3
6.1	审计报告基本信息	3
6.2	审计报告的基本内容	3
§7	年度财务报表	3
7.1	资产负债表	3
7.2	利润表	3
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	3
7.4	报表附注	3
§8	投资组合报告	3
8.1	期末基金资产组合情况	3
8.2.1	报告期末按行业分类的境内股票投资组合	3
8.3	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	3
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	3
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	3
8.6	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	3
8.7	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	3
8.8	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	3
8.9	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	3
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	3
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	3
8.12	投资组合报告附注	3
§9	基金份额持有人信息	3
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	3

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	3
9.3 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.....	3
§10 开放式基金份额变动.....	3
§11 重大事件揭示.....	3
11.1 基金份额持有人大会决议.....	3
11.2 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.....	3
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	3
11.4 基金投资策略的改变.....	3
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	3
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	3
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	3
11.8 其他重大事件.....	3
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	3
§13 备查文件目录.....	3
13.1 备查文件目录.....	3
13.2 存放地点.....	3
13.3 查阅方式.....	3

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金
基金简称	创金合信尊盈纯债债券
基金主代码	002337
基金运作方式	开放式
基金合同生效日	2016年1月7日
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	499,978,681.87
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求当期收入和投资总回报最大化。
投资策略	本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪，基于对利率、信用等市场的分析和预测，综合运用久期配置策略、跨市场套利、杠杆放大等策略，力争实现基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，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	创金合信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋
	联系电话	0755-23838908
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	95555

传真	0755-25832571	0755-83195201
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1号A栋201 室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518000	518040
法定代表人	刘学民	李建红

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjxfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
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楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016年1月7日-2016年12月31日
本期已实现收益	23,007,071.87
本期利润	16,154,149.27
加权平均基金份额本期利润	0.0344
本期加权平均净值利润率	3.38%

本期基金份额净值增长率	3.67%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2016年末
期末可供分配利润	-2,715,320.43
期末可供分配基金份额利润	-0.0054
期末基金资产净值	497,263,361.44
期末基金份额净值	0.995
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2016年末
基金份额累计净值增长率	3.67%

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。

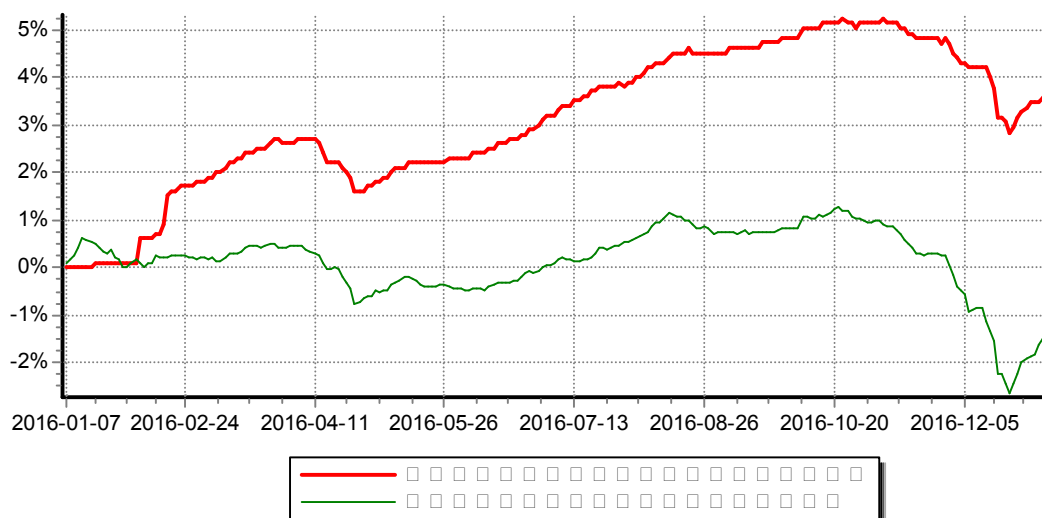
4.本基金合同生效日为2016年1月7日，截至报告期末，本基金成立不满一年。合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

## 3.2 基金净值表现

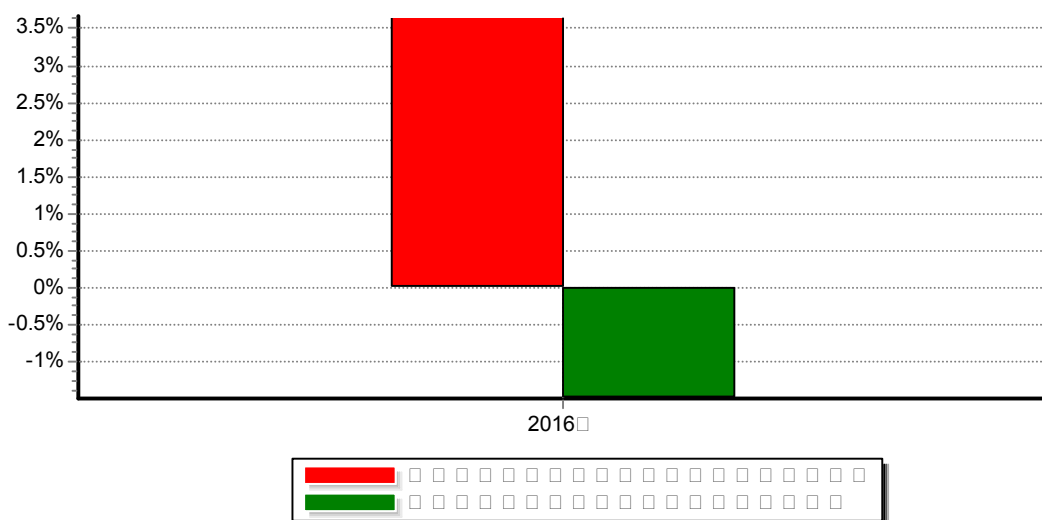
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-1.10%	0.12%	-2.32%	0.15%	1.22%	-0.03%
过去六个月	0.65%	0.09%	-1.42%	0.11%	2.07%	-0.02%
自基金合同生效日起至今（2016年01月07日-2016年12月31日）	3.67%	0.09%	-1.49%	0.09%	5.16%	—

### 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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	0.420	21,005,592.11	3,682.04	21,009,274.15	
合计	0.420	21,005,592.11	3,682.04	21,009,274.15	



## 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3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17只公募基金。截至2016年12月31日，本公司共管理24只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品3只、债券型产品8只、股票型产品3只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约142.74亿元。

### 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		
王一兵	基金经理、固定收益部总监	2016年1月7日	—	12	王一兵先生，中国国籍，四川大学MBA。1994年即进入证券期货行业，作为公司出市代表任海南中商期货交易所红马甲。1997年进入股票市场，经历了各种证券市场的大幅涨跌变化，拥有成熟的投资心态和丰富的投资经验。曾历任第一创业证券固定收益部高级交易经理、资产管理部投资经理、固定收益部投资副总监。现任创金合信基金管理有限公司固定收益部负责人。熟悉债券市场和固定收益产

					品的各种投资技巧，尤其精通近两年发展迅速的信用债，对企业信用分析、定价有深刻独到的见解。
郑振源	基金经 理	2016年1月 7日	—	7	郑振源先生，中国国籍，中国人民银行研究生部经济学硕士。2009年7月加入第一创业证券研究所，担任宏观债券研究员。2012年7月加入第一创业证券资产管理部，先后担任宏观债券研究员、投资主办等职务。2014年8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公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算的起止时间按照从事证券行业开始时间计算。

#### 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、《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同》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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《创金合信基金管理有限公司公平

交易制度》，该《制度》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资风格库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

#### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易室总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

#### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易室负责异常交易的日常实时监控，监察稽核部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如1日内、3日、5日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

### 4.3.2 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。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《创金合信基金管理有限公司公平交易制度》对本年度同向交易价差、反向交易进行了专项分析，未发现异常交易情况。

#### 4.3.3 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。

### 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

2016年成为2014年以来债牛的末期，并在年底开始扭转走熊。主要变化因素在于：第一，2016年经济整体走平，步入L型的底部阶段，而同时大宗商品价格暴涨、以房价为首的资产价格暴涨；第二，5月9日《人民日报》刊登了《开局首季问大势》的权威人士讲话，正式确认了宏观政策从稳增长向防风险、抑泡沫重心转换；第三，在经济走稳、通胀预期抬升的基础上，为防风险、抑泡沫，货币政策最终在下半年开始通过公开市场释放长期限资金，抬升利率水平，并实施将理财纳入MPA考核等宏观审慎措施。在上述因素变化下，同时叠加了流动性危机，年底债市收益率大幅上行，幅度普遍在100-150bp。在债券市场极度紧张时期，央行及时释放流动性，守住系统性风险不发生的底线。2016年本基金采取稳健投资策略，在防范风险的同时为投资者赚取更好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年本基金净值增长率为3.67%，同期业绩比较基准增长率为-1.49%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前来看，货币政策可能进一步收紧，但大幅收紧的可能性需要密切关注经济。主要原因在于：第一，防风险、抑泡沫仍是当前货币政策的目标重点，也因此存在进一步收紧的可能；第二，从目前来看，房地产价格的泡沫程度得到初步控制，一二线热点城市房价环比涨幅持续回落，而债市、汇市、股市等领域的泡沫程度不显著，同时表外理财扩张也受到宏观审慎评估体系（简称MPA）约束，因此央行就风险泡沫大幅收紧的必要性还不是很大；第三，年初信贷放量的持续性将是需要密切关注的。如果是实体经济需求强劲所致，那么通胀压力将会较大，货币政策的收紧力度有可能会超出预期。在货币政策收缩的过程中，债券市场难以出现趋势性机会，而在政策步入紧缩后期和经济下行压力重现之前，长债的交易机会也不会明显。经过去年底及今年初的大幅调整，债市总体收益率水平已处于较高的位置，尤其是高评级的配置价值仍

是可以的，再度急剧上升的风险不显著。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人的主要内部监察稽核工作如下：

(1) 开展全面自查工作，排查各项业务活动中存在的问题或潜在的风险隐患，制定整改计划，并督促按计划完成整改；

(2) 开展公司专项稽核工作，了解合规风险现状、发现薄弱环节，并持续督导改进；

(3) 强化合规法务工作。严格审核公司业务、产品及其合同等法律文件，解读最新的法律法规，发布合规提示或警示，举办合规培训；

(4) 建立健全全面风险管理体系。全面梳理各业务部门的职责与权限，理顺工作流程；同时加强权限管理，健全事前、事中和事后的风险管理体系；

(5) 完善信息披露工作。修订完善《信息披露制度》等制度，建立统一规范信息披露流程，明确各部门信息披露的职责分工，及时履行信息披露工作；

(6) 加强关联交易管理。修订《关联交易管理制度》，履行关联交易决策审批程序；

(7) 建立内幕交易防控机制。公司建立了《内幕交易防控管理办法》，定期开展关于防止内幕交易的合规培训，严防内幕信息传递和内幕交易发生；

(8) 建立健全公平交易与异常交易管理机制。严格按照法律法规以及公司《公平交易制度》、《异常交易监控与报告制度》的要求，对所管理的不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控，严格禁止同一投资组合在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为；

(9) 建立员工投资行为管理机制，规范员工的证券投资行为。

本基金管理人将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 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。

本基金管理人在风险控制办公会下设估值小组，组长由公司总经理担任，成员由基金运营部、研究部、监察稽核部、综合部人员组成，实行一人一票制，可邀请专业人士列席，但不具表决权，基金运营部是估值小组的日常办事机构。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内，本基金已实施利润分配21,009,274.15元，符合合同约定。

#### **4.9 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**

托管人声明，在本报告期内，基金托管人-招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### **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**

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第1700418号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金(以下简称"创金合信尊盈纯债债券")财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表,自2016年1月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是创金合信尊盈纯债债券的管理人创金合信基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计

	<p>证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价创金合信基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，创金合信尊盈纯债债券的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映创金合信尊盈纯债债券2016年12月31日的财务状况以及自2016年1月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	左艳霞、吴钟鸣
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2017-03-23

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末
----	-----	-----



		2016年12月31日
<b>资产:</b>		
银行存款	7.4.7.1	2,579,015.30
结算备付金		9,482,692.32
存出保证金		4,934.02
交易性金融资产	7.4.7.2	601,769,591.30
其中: 股票投资		—
基金投资		—
债券投资		524,702,005.00
资产支持证券投资		77,067,586.30
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	12,770,750.15
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		626,606,983.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		129,055,869.42
应付证券清算款		46,595.38
应付赎回款		98.70
应付管理人报酬		126,474.39

应付托管费		42,158.15
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	1,386.36
应交税费		—
应付利息		9,039.25
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	62,000.00
负债合计		129,343,621.65
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	499,978,681.87
未分配利润	7.4.7.10	-2,715,320.43
所有者权益合计		497,263,361.44
负债和所有者权益总计		626,606,983.09

注：1.报告截止日2016年12月31日，基金份额净值0.995元，基金份额总额499,978,681.87份。

2.本财务报表的实际报告期间为2016年1月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满1年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月7日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月7日至2016年12月31日
一、收入		19,959,188.57
1.利息收入		25,843,028.69
其中：存款利息收入	7.4.7.11	332,095.73
债券利息收入		24,116,387.54
资产支持证券利息收入		1,156,516.63
买入返售金融资产收		238,028.79

入		
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		967,650.90
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	1,035,198.84
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-67,547.94
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.14	—
股利收益	7.4.7.15	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-6,852,922.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,431.58
<b>减：二、费用</b>		3,805,039.30
1. 管理人报酬		1,397,388.72
2. 托管费		465,796.26
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.18	8,076.59
5. 利息支出		1,746,518.43
其中：卖出回购金融资产支出		1,746,518.43
6. 其他费用	7.4.7.19	187,259.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,154,149.27
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		16,154,149.27

”号填列)

注：本财务报表的实际报告期间为2016年1月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满1年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月7日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月7日至2016年12月31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)	200,122,552.48	—	200,122,552.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	16,154,149.27	16,154,149.27
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）	299,856,129.39	2,139,804.45	301,995,933.84
其中：1.基金申购款	302,882,202.95	2,202,189.79	305,084,392.74
2.基金赎回款	-3,026,073.56	-62,385.34	-3,088,458.90
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）	—	-21,009,274.15	-21,009,274.15
五、期末所有者权益（基金净值）	499,978,681.87	-2,715,320.43	497,263,361.44

注：本财务报表的实际报告期间为2016年1月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满1年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金(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")《关于准予创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]3078号文)批准,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》及其配套规则和《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2016年1月7日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为200,122,552.48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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")。

本基金于2016年1月4日至2016年1月5日募集,募集期间净认购资金人民币200,113,549.63元,认购资金在募集期间产生的利息人民币9,002.85元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计200,122,552.48份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第1600141号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于固定收益类品种,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(含可分离交易可转债)、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等。本基金不从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购和新股增发。因所持可转换债券与可交换债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证,在其可上市交易后不超过10个交易日的时间内卖出。本基金的业绩比较基准为:中债综合(全价)指数收益率。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合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,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况、自2016年1月7日(基金合同生效日)至2016年12月31日止

期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2016年1月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 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、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 7.4.4.4 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，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。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，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-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。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-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采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

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。

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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，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。

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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金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；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 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认列。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认列。上述申购和赎回分别包括基金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。

#### 7.4.4.8 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)"。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

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(如适用)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。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产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。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行债券等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。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(a)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；

(b)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；

(c)每一基金份额享有同等分配权；

(d)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(e)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，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》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，

按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局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[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部 国家税务总局 证监会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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015]125号文《关于内地与香港基金互认有关

税收政策的通知》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：

(a)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。

(b)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2017年7月1日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。因此，截至2016年12月31日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e)对基金取得的股票的股息、红利收入，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。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照10%的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g)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。

(h)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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
活期存款	2,579,015.30
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	2,579,015.30

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	150,348,365.75	147,482,505.00
	银行间市场	381,168,561.85	377,219,500.00
	合计	531,516,927.60	524,702,005.00
资产支持证券	77,105,586.30	77,067,586.30	-38,000.00
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	608,622,513.90	601,769,591.30	-6,852,922.60

**7.4.7.3 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。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	1,147.20
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	4,693.92
应收债券利息	12,399,569.63
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	365,339.40
合计	12,770,750.15

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	1,386.36
合计	1,386.36

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	62,000.00
合计	62,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月7日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	200,122,552.48	200,122,552.48
本期申购	302,882,202.95	302,882,202.95
本期赎回（以“-”号填列）	-3,026,073.56	-3,026,073.56
本期末	499,978,681.87	499,978,681.87

注：1. 申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

2. 本基金自2016年1月4日至2016年1月5日止期间公开发售，共募集有效净认购资金200,122,552.48元。根据《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入9,002.85元，在本基金成立后折算为9,002.85份基金份额，划入基金份额持有人账户。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

基金合同生效日	—	—	—
本期利润	23,007,071.87	-6,852,922.60	16,154,149.27
本期基金份额交易产生的变动数	639,362.70	1,500,441.75	2,139,804.45
其中：基金申购款	686,223.31	1,515,966.48	2,202,189.79
基金赎回款	-46,860.61	-15,524.73	-62,385.34
本期已分配利润	-21,009,274.15	—	-21,009,274.15
本期末	2,637,160.42	-5,352,480.85	-2,715,320.43

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月7日至2016年12月31日
活期存款利息收入	116,001.57
定期存款利息收入	165,500.00
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	50,565.55
其他	28.61
合计	332,095.73

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月7日至2016年12月31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	1,035,198.84
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	1,035,198.84

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月7日至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	308,321,593.07
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	301,304,386.15
减：应收利息总额	5,982,008.08
买卖债券差价收入	1,035,198.84

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月7日至2016年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	20,027,630.14
减：卖出资产支持证券成本总额	20,054,805.48
减：应收利息总额	40,372.60
资产支持证券投资收益	-67,547.94

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益



单位：人民币元

项目	本期 2016年1月7日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	-6,852,922.60
——股票投资	—
——债券投资	-6,814,922.60
——资产支持证券投资	-38,000.00
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-6,852,922.60

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月7日至2016年12月31日
基金赎回费收入	1,431.58
合计	1,431.58

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月7日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	647.69
银行间市场交易费用	7,428.90
合计	8,076.59

## 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月7日至2016年12月31日
审计费用	53,000.00
信息披露费	90,000.00
帐户维护费	31,900.00
汇划手续费	11,659.30
查询服务费	700.00
合计	187,259.30

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
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

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月7日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券	87,998,365.75	100.00%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月7日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券	10,321,000,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月7日至2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	810.63

注：支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日基金管理费=前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月7日至2016年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	465,796.26	

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内与关联方无银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.4.2 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

本报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 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	
	2016年1月7日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行活期存款	2,579,015.30	116,001.57

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按金融机构同业存款利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形 式 发放	再投资形式 发放	利润分 配 合计	备注
1	2016-07-29	2016-07-29	0.250	12,505,5 48.75	2,012.12	12,507,5 60.87	
2	2016-11-14	2016-11-14	0.170	8,500,04 3.36	1,669.92	8,501,71 3.28	
合计			0.420	21,005,5 92.11	3,682.04	21,009,2 74.15	

#### 7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31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7,055,869.42元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名 称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101654002	16平安 租赁 MTN00 1	2017-01-04	99.50	72,000	7,164,000.00
合计				72,000	7,164,000.00

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，基金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122,000,000.00元，于2017年1月3日到期。该类交易要求本基金在

回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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招商银行，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。

#### 7.4.13.2.1 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 2016年12月31日
A-1	—
A-1以下	—
其他评级	39,968,000.00
未评级	—

合计	39,968,000.00
----	---------------

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等利率债券。

#### 7.4.13.2.2 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 2016年12月31日
AAA	178,856,500.00
AAA以下	313,588,091.30
	—
未评级	69,357,000.00
合计	561,801,591.30

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等利率债券。

#### 7.4.13.3 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股票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公司的证券不得超过该证券的10%。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7.4.12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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2016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	2,579,015.30	—	—	—	2,579,015.30
结算备付金	9,482,692.32	—	—	—	9,482,692.32
存出保证金	4,934.02	—	—	—	4,934.02
交易性金融资产	121,103,000.00	480,469,086.30	197,505.00	—	601,769,591.30
应收利息	—	—	—	12,770,750.15	12,770,750.15
资产总计	133,169,641.64	480,469,086.30	197,505.00	12,770,750.15	626,606,983.09
负债					



卖出回购金融资产款	129,055,869.42	—	—	—	129,055,869.42
应付证券清算款	—	—	—	46,595.38	46,595.38
应付赎回款	—	—	—	98.70	98.70
应付管理人报酬	—	—	—	126,474.39	126,474.39
应付托管费	—	—	—	42,158.15	42,158.15
应付交易费用	—	—	—	1,386.36	1,386.36
应付利息	—	—	—	9,039.25	9,039.25
其他负债	—	—	—	62,000.00	62,000.00
负债总计	129,055,869.42	—	—	287,752.23	129,343,621.65
利率敏感度缺口	4,113,772.22	480,469,086.30	197,505.00	12,482,997.92	497,263,361.44

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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2016年12月31日
	市场利率上升25个基点	-2,098,558.62
	市场利率下降25个基点	2,113,828.52

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有股票投资、权证投资等权益性投资，若除市场利率和外汇汇率外的其他市场因素变化导致本基金所持有的权益性投资的市场价格上升或下降5%且其他市场变量保持不变，对于本基金的基金资产净值无重大影响。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 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2016年12月31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197,505.00元，属于第二层次的余额为601,572,086.30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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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2016年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

7.4.14.2除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	601,769,591.30	96.04
	其中:债券	524,702,005.00	83.74
	资产支持证券	77,067,586.30	12.30
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	12,061,707.62	1.92
7	其他各项资产	12,775,684.17	2.04
8	合计	626,606,983.09	100.00

## 8.2 报告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。

## 8.3 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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

## 8.5 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	110,825,000.00	22.29
	其中：政策性金融债	69,357,000.00	13.95
4	企业债券	253,746,500.00	51.03
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	159,933,000.00	32.16
7	可转债	197,505.00	0.04
8	同业存单	—	—

9	其他	—	—
10	合计	524,702,005.00	105.52

### 8.6 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	136446	16电投02	500,000	49,460,000.00	9.95
2	130224	13国开24	500,000	49,335,000.00	9.92
3	101660017	16浙商集MTN001	500,000	49,300,000.00	9.91
4	136631	16南瑞01	500,000	48,995,000.00	9.85
5	136258	16财通债	500,000	48,830,000.00	9.82

### 8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	权证名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1689257	16粤鑫1A	400,000	39,968,000.00	8.04
2	1689337	16爽元1A	200,000	19,994,000.00	4.02
3	116102	三电优07	170,000	17,105,586.30	3.44

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 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投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本报告期内基金投资的前十名证券发行主体未受到监管部门的立案调查，在编制日前一年内也未收到公开谴责和处罚。

### 8.12.2

本基金未投资于股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,934.02
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	12,770,750.15
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	12,775,684.17

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有的基	持有人结构
-------	--------	-------

(户)	金份额	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
196	2,550,911.64	499,864,064.73	99.98%	114,617.14	0.02%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	21,728.06	—

## 9.3 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年1月7日)基金份额总额	200,122,552.48
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	302,882,202.95
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,026,073.56
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	499,978,681.87

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

#### 11.5 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更换会计师事务所，本年度支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用53,000.00元，该审计机构连续提供审计服务的年限为1年。

#### 11.6 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。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业证券	2	—	—	—	—	
光大证券	2	—	—	—	—	

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。

本基金在报告期内成立，交易单元均于本期内新增。



## 11.7.2 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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
第一创业证券	87,998,365.75	100.00%	10,321,000,000.00	100.00%	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—

## 11.8 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关于创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金提前结束募集的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-06
2	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、中国证券报	2016-01-07
3	创金合信基金关于调整旗下部分开放式基金申购金额下限及最低持有金额下限的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-08
4	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务公告	公司官网、中国证券报	2016-01-23
5	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金暂停大额申购公告	公司官网、中国证券报	2016-03-17
6	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金暂停(大额)申购(转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资)公告	公司官网、中国证券报	2016-03-22
7	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金2016年第1季度报告	公司官网、中国证券报	2016-04-22

8	创金合信基金管理有限公司关于旗下基金开展微信直销平台认购费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-24
9	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金2016年第2季度报告	公司官网、中国证券报	2016-07-20
10	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金分红公告	公司官网、中国证券报	2016-07-27
11	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金（2016年第1号）招募说明书（更新）	公司官网、中国证券报	2016-08-10
12	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金（2016年第1号）招募说明书（摘要）	公司官网、中国证券报	2016-08-10
13	创金合信基金关于调整官方微信平台认购及申购费率的公告	公司官网、中国证券报	2016-08-17
14	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金2016年半年度报告	公司官网、中国证券报	2016-08-27
15	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金2016年半年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2016-08-27
16	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金2016年第3季度报告	公司官网、中国证券报	2016-10-24
17	创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金分红公告	公司官网、中国证券报	2016-11-11

## § 12 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1、《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同》；2、《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金托管协议》；3、创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金2016年年度

报告

**13.2 存放地点**

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

**13.3 查阅方式**

[www.cjhxfund.com](http://www.cjhxfund.com)

创金合信基金管理有限公司

二〇一七年三月二十七日