

# 中金纯债债券型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 30 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 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	279,703,829.73 份	
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	174,023,008.95 份	105,680,820.78 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

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### § 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		2015 年		2014 年 11 月 4 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日	
	中金纯债 A	中金纯债 C	中金纯债 A	中金纯债 C	中金纯债 A	中金纯债 C
本期已实现收益	7,735,353.56	424,659.72	14,078,203.69	2,894,931.80	4,980,136.57	931,274.05
本期利润	3,282,735.22	-1,362,784.77	14,728,795.26	3,101,711.19	6,027,771.26	1,481,751.28
加权平均基金份额本期利润	0.0176	-0.0487	0.0735	0.0709	0.0067	0.0078
本期基金份额净值增长率	0.83%	0.28%	7.62%	7.13%	1.10%	1.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0965	0.0852	0.0807	0.0750	0.0060	0.0051
期末基金资产净值	190,819,169.34	114,689,156.33	113,376,151.93	46,659,939.88	568,226,560.33	153,497,493.63
期末	1.097	1.085	1.088	1.082	1.011	1.010

基金 份额 净值						
----------------	--	--	--	--	--	--

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；

4、本基金合同于 2014 年 11 月 4 日生效，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

中金纯债 A

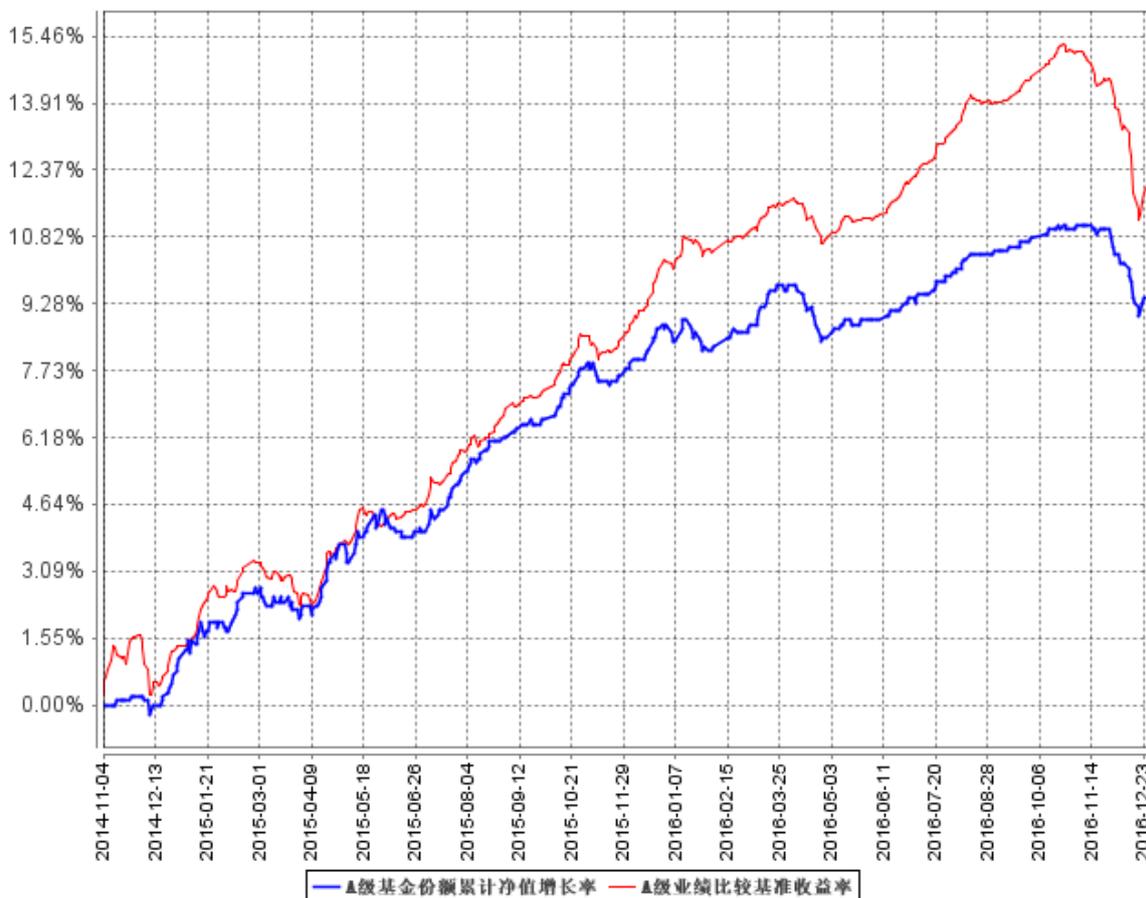
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.99%	0.09%	-1.79%	0.15%	0.80%	-0.06%
过去六个月	0.27%	0.07%	0.37%	0.11%	-0.10%	-0.04%
过去一年	0.83%	0.08%	2.00%	0.09%	-1.17%	-0.01%
自基金合同生效起至今	9.70%	0.09%	12.46%	0.10%	-2.76%	-0.01%

中金纯债 C

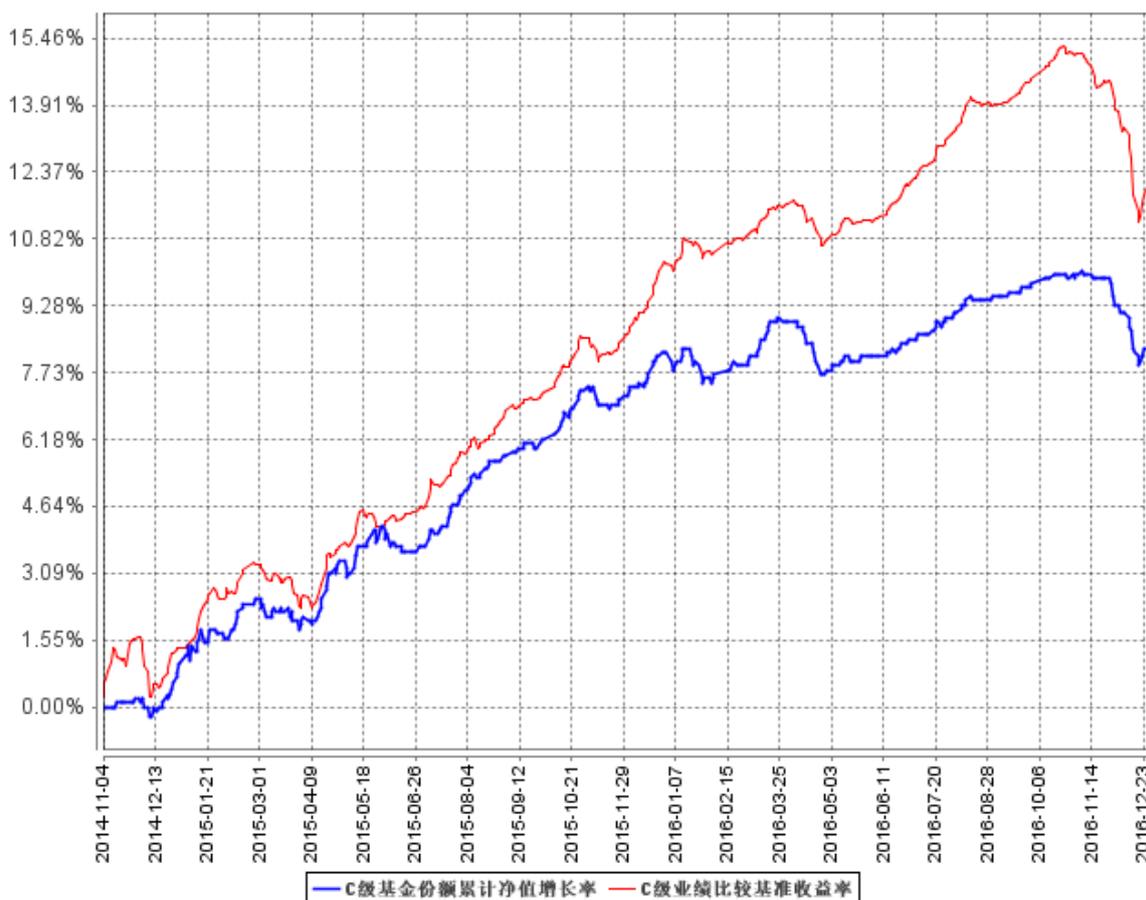
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.18%	0.09%	-1.79%	0.15%	0.61%	-0.06%
过去六个月	0.00%	0.07%	0.37%	0.11%	-0.37%	-0.04%
过去一年	0.28%	0.08%	2.00%	0.09%	-1.72%	-0.01%
自基金合同生效起至今	8.50%	0.09%	12.46%	0.10%	-3.96%	-0.01%

#### 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**

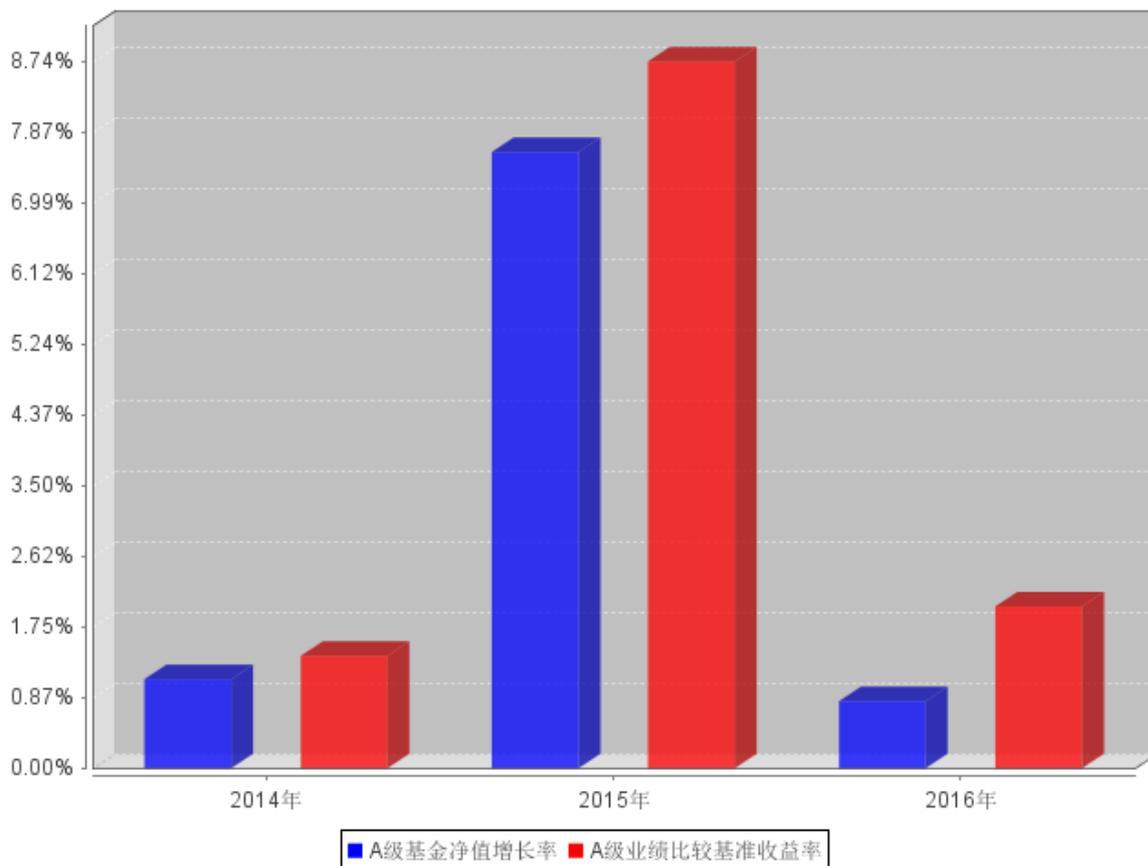


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

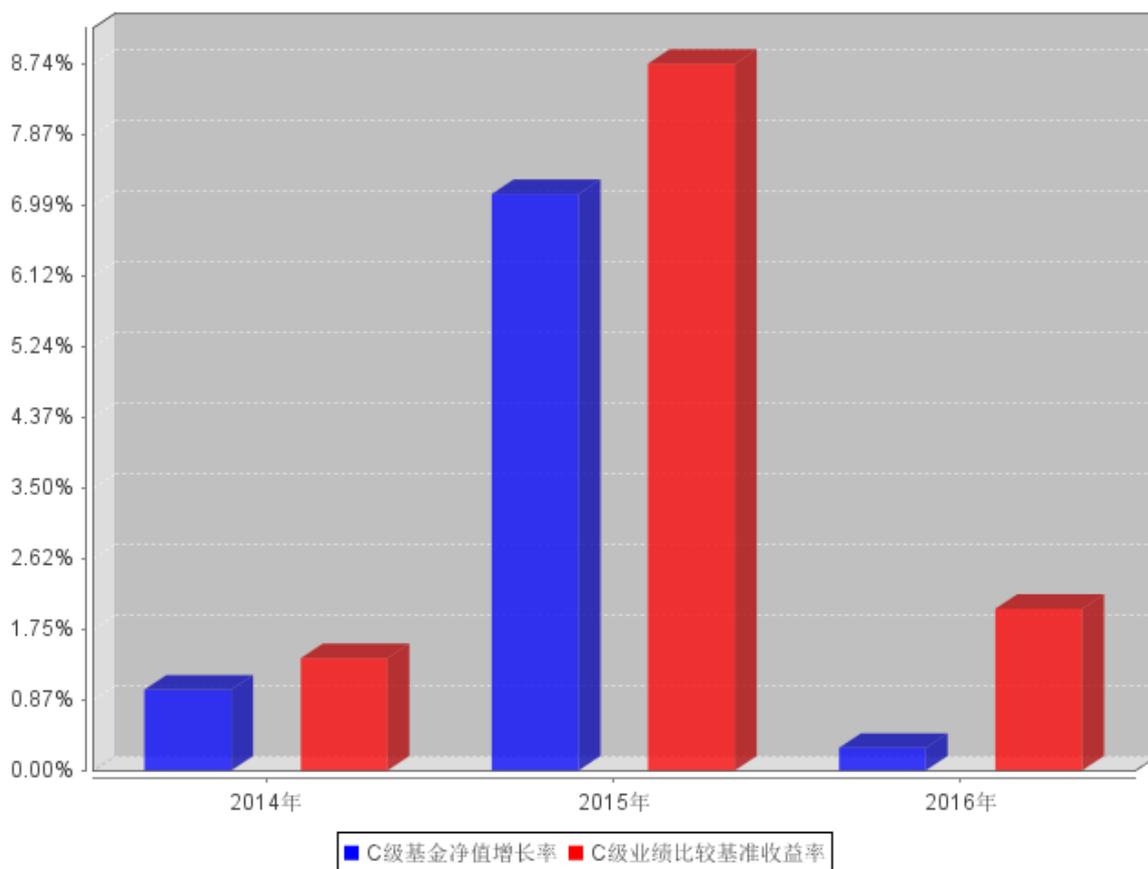


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**A级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对比图**



**C级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对比图**



注:本基金合同生效日为 2014 年 11 月 4 日, 合同生效当年按实际存续期计算, 不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

根据基金相关法律法规和基金合同的要求, 结合本基金实际运作情况, 自成立以来本基金未进行收益分配。

## § 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”、“公司”）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 2.00 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。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理 8 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、中金消费升级股票型证券投资基金、中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金和中金金利债券型证券投资基金，证券投资基金管理规模 35.64 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	本基金原基金经理	2014 年 11 月 4 日	2016 年 7 月 15 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。原任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理，2014 年 11 月 4 日起任中金纯债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 7 月 15 日离任。
石玉	本基金的基金	2016 年 7 月 16 日	-	9	石玉女士，天津大学管理学硕士。历任中

	<p>经理</p>			<p>国科技证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司职员，天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员，中国国际金融股份有限公司资产管理部高级研究员、基金经理助理、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，2016 年 7 月 16 日起兼任中金现金管家货币市场基金基金经理，2016 年 12 月 13 日起担任中金金利债券型证券投资基金基金经理</p>
--	-----------	--	--	--

- 注：1、本报告期内，基金经理由石云峰先生变更为石玉女士；
- 2、原任基金经理石云峰先生任职日期为基金合同生效日，石玉女士任职日期为基金经理变更公告确定的任职日期；
- 3、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；
- 4、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》、《公开募集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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、

公平交易实施效果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

报告期内，2016 年在供给侧改革、财政刺激、房地产投资上升的带动下，经济基本面发生了比较积极的变化，CPI 数据略高于 2015 年，PPI 数据大幅改善，汇率出现较强贬值压力，货币政策在 2016 年 2 月底公布降低 0.5% 的存款准备金率，此后央行没有再降准、降存款利率，而是从 8 月开始央行重启 14 天逆回购，9 月又重启 28 天逆回购，进行降低 7 天逆回购操作量增加长期限逆回购量的置换操作，资金面在 1 季度到 3 季度偏宽松，4 季度资金面趋于紧张。

报告期内，债券市场在 2016 年大幅波动。中债综合财富总值指数在上半年的 4 月出现小幅回调，下半年的 10 月下旬到 12 月中旬出现大幅深度回调，相同时间内的回调深度远高于 2013 年。全年中债综合财富总值指数上涨 1.83%。

报告期内，本着稳健投资原则，基于流动性、风险和收益的考虑，在追求相对稳定的投资收益前提下，重点配置了利率债和期限较短的中高等级信用债。随着债券市场在 2016 年 1 季度到 3 季度的走牛，债券收益率不断下行，信用利差和期限利差都被压缩到非常低的水平，配置价值

逐渐降低，组合对期限较长或收益率较低的债券进行了减仓操作。

#### 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 0.83%，中金纯债 C 类份额净值增长率为 0.28%，同期业绩比较基准收益率为 2.00%。

#### 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 2017 年，预估经济基本面在上半年仍然较好，下半年在房地产投资可能下滑的带动下，存在走弱的可能，通胀方面，2017 年的通胀水平较大可能高于 2016 年，因此对货币政策的放松存在制约，资金面方面，在去杠杆、控金融风险的背景下，货币政策已经从 2016 年四季度开始从中性偏松转向中性偏紧，因此预估 2017 年上半年的资金面不乐观。

总体而言，对于 2017 年上半年的债券市场表现偏谨慎，但也需要关注下半年经济基本面可能走弱带来的货币政策放松，以及债券市场的投资机会。

本着稳健投资原则，本基金将在 2017 年继续根据对基本面的判断，评估债券市场可能的走势，适时调整组合久期和杠杆率，争取为投资人获取相对稳定可期的投资回报。

#### 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，本基金管理人进一步健全了风险控制和监察稽核机制，根据不同的基金特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划。

首先本基金管理人以中国证监会《季度监察稽核项目表》为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查。在持续关注《季度监察稽核项目表》中识别的风险点进行自查的同时，还定期进行有重点的检查。在研究投资交易环节，本基金管理人对投资对象建立筛选流程、对投资对象池（库）进行日常维护与更新，并对基金的投资比例进行日常监控，对关联交易的日常维护，对基金持仓流动性风险定期关注，并对公平交易知情情况进行检查等；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的检查来确保本基金财务数据的准确性；在法律合规方面，本基金管理人对公司制度规范、合同协议、产品方案、对外文件等进行合规性审核。本基金管理人对监察稽核工作流程进行了完善和优化，并按照既定的稽核计划开展内部稽核，对检查出来的问题及时提出改进意见并督促相关部门有效落实。

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露内容真实、准确、完整、及时。

#### 4.7 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、监察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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同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。

#### 4.9 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 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 1701517 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	中金纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的中金纯债债券型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、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该基金管理人中金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	<p>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。</p> <p>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中金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	我们认为，该基金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 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，公允反映了该基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

注册会计师的姓名	程海良	管祎铭
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	中国北京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层	
审计报告日期	2017 年 3 月 30 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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：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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		1,808,299.22	248,153.26
结算备付金		1,395,829.77	3,000,434.72
存出保证金		6,454.56	15,957.42
交易性金融资产		304,626,340.00	178,854,521.74
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		304,626,340.00	178,854,521.74
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	594,765.07
应收利息		4,064,569.14	2,227,641.50
应收股利		-	-
应收申购款		-	51,975.15
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		311,901,492.69	184,993,448.86
<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>上年度末 2015 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		-	-
卖出回购金融资产款		5,500,000.00	24,200,000.00
应付证券清算款		122.22	-
应付赎回款		267,872.06	247,666.02
应付管理人报酬		181,896.54	78,347.54
应付托管费		51,970.44	22,385.00
应付销售服务费		39,017.20	8,646.31
应付交易费用		9,693.88	1,225.00
应交税费		-	-

应付利息		3,594.68	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		339,000.00	399,087.18
负债合计		6,393,167.02	24,957,357.05
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		279,703,829.73	147,352,262.12
未分配利润		25,804,495.94	12,683,829.69
所有者权益合计		305,508,325.67	160,036,091.81
负债和所有者权益总计		311,901,492.69	184,993,448.86

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，中金纯债债券型证券投资基金 A 类基金份额净值为人民币 1.097 元（2015 年 12 月 31 日：人民币 1.088 元），中金纯债债券型证券投资基金 C 类基金份额净值为人民币 1.085 元（2015 年 12 月 31 日：人民币 1.082 元）；基金份额总额为 279,703,829.73 份（2015 年 12 月 31 日：147,352,262.12 份），其中中金纯债基金 A 类基金份额为 174,023,008.95 份（2015 年 12 月 31 日：104,230,372.17 份）；中金纯债基金 C 类基金份额为 105,680,820.78 份（2015 年 12 月 31 日：43,121,889.95 份）。

## 7.2 利润表

会计主体：中金纯债债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		4,971,261.68	22,298,521.71
1.利息收入		12,043,317.12	16,102,549.81
其中：存款利息收入		64,873.38	159,789.91
债券利息收入		11,891,564.94	15,938,008.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		86,878.80	4,751.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-882,811.43	5,202,542.41
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-882,811.43	5,202,542.41
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-6,240,062.83	857,370.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		50,818.82	136,058.53
<b>减：二、费用</b>		<b>3,051,311.23</b>	<b>4,468,015.26</b>
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,643,613.12	1,811,821.28
2. 托管费	7.4.8.2.2	469,603.81	517,663.24
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	119,130.74	185,837.39
4. 交易费用		9,874.68	13,832.68
5. 利息支出		522,178.46	1,499,292.47
其中：卖出回购金融资产支出		522,178.46	1,499,292.47
6. 其他费用		286,910.42	439,568.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,919,950.45</b>	<b>17,830,506.45</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,919,950.45</b>	<b>17,830,506.45</b>

注：本基金合同生效日为 2014 年 11 月 4 日。

### 7.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 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）	147,352,262.12	12,683,829.69	160,036,091.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,919,950.45	1,919,950.45
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）	132,351,567.61	11,200,715.80	143,552,283.41
其中：1. 基金申购款	377,357,001.72	35,709,697.42	413,066,699.14
2. 基金赎回款	-245,005,434.11	-24,508,981.62	-269,514,415.73
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）	279,703,829.73	25,804,495.94	305,508,325.67
项目	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015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）	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（本期净利润）	-	17,830,506.45	17,830,506.45
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）	-567,010,599.80	-12,507,868.80	-579,518,468.60
其中：1. 基金申购款	122,608,373.64	6,936,369.61	129,544,743.25
2. 基金赎回款	-689,618,973.44	-19,444,238.41	-709,063,211.85
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）	147,352,262.12	12,683,829.69	160,036,091.81

注：本基金合同生效日为 2014 年 11 月 4 日。

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：

\_\_\_\_\_  
孙菁

\_\_\_\_\_  
杜季柳

\_\_\_\_\_  
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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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《关于核准中金纯债债券型证券投资基金注册的批复》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》及配套规则和《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。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“建设银行”)。

本基金通过管理人中金基金直销柜台、建设银行及中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)公开发售,募集期为 2014 年 9 月 29 日至 2014 年 10 月 29 日。经向中国证监会备案,《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 4 日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为 1,255,808,243.86 份(含利息转份额 446,319.43 份),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。

根据经中国证监会备案的《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》的相关内容,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购 / 申购时,收取认购 / 申购费用,但从本类别基金资产中不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;不收取认购 / 申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

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固定收益类金融工具,包括: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或增发新股,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。

#### 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、2016 年度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

### 7.4.5 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

无

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无

### 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。

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)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。

(g)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 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
建设银行	基金托管人、基金销售机构
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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

### 7.4.8.1.1 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。

### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	271,879,932.21	100.00%	964,709,351.33	100.00%

### 7.4.8.1.3 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1日至2016年12月 31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	1,939,200,000.00	100.00%	11,072,771,000.00	100.00%

### 7.4.8.1.4 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。

### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本年度与上年度均没有应支付关联方的佣金。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,643,613.12	1,811,821.28
其中：支付销售机构的	153,409.85	1,057,385.85

客户维护费		
-------	--	--

注：1、支付基金管理人中金基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70% / 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服务机构的客户维护费为零，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项目。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	469,603.81	517,663.24

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	-	75,164.40	75,164.40
中国建设银行	-	33,234.65	33,234.65
中金公司	-	3,534.37	3,534.37
合计	-	111,933.42	111,933.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	-	7,996.05	7,996.05
中国建设银行	-	172,105.97	172,105.97
中金公司	-	1,973.59	1,973.59
合计	-	182,075.61	182,075.61

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；本基金 C 类基金份额收取销售服务费。支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。C 类基金份额每日应计提的销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划转指令。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本基金本报告期与上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金于本基金本报告期与上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中金纯债 C				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中金公司	-	-	27,803,521.78	18.8700%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	1,808,299.22	33,389.79	248,153.26	49,609.98

注：本基金通过“中国建设银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,395,829.77 元（2015 年 12 月 31 日：人民币 3,000,434.72 元），本年产生的利息收入为人民币 18,148.13 元

(2015 年 12 月 31 日：人民币 107,302.49 元)。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本基金本报告期与上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

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

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 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暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未发生银行间市场债券正回购交易。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至 2016 年 12 月 31 日，本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人民币 5,500,000.00 元（于 2015 年 12 月 31 日：人民币 24,200,000.00 元），其中卖出回购证券款人民币 500,000.00 元于 2017 年 1 月 3 日到期，剩余部分于 2017 年 1 月 9 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。

#### 7.4.10 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 公允价值计量

(a) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：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；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

	2016 年 12 月 31 日			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
持续的公允价值 计量资产				
交易性金融资产				
债券投资	-	304,626,340.00	-	304,626,340.00
持续以公允价值 计量的资产总额	-	304,626,340.00	-	304,626,340.00

单位：人民币元

	2015 年 12 月 31 日			
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
持续的公允价值 计量资产				
交易性金融资产				
债券投资	-	178,854,521.74	-	178,854,521.74
持续以公允价值 计量的资产总额	-	178,854,521.74	-	178,854,521.74

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息，本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设详见附注。

(b) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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）、或属于限售期间等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。2016 年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具于 2016 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2015 年 12 月 31 日：无）。

#### **7.4.14.2 其他金融工具的公允价值 (年末非以公允价值计量的项目)**

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之间无重大差异。

## § 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	304,626,340.00	97.67
	其中：债券	304,626,340.00	97.67
	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	3,204,128.99	1.03
7	其他各项资产	4,071,023.70	1.31
8	合计	311,901,492.69	100.00

### 8.2 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。

### 8.3 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

本基金本报告期末未持有股票资产。

### 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。

#### 8.4.2 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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票交易。

### 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	21,984,600.00	7.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	162,139,740.00	53.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	120,502,000.00	39.44
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	304,626,340.00	99.71

### 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	101552021	15 德力西 MTN001	200,000	20,370,000.00	6.67
2	101452017	14 紫江集 MTN001	200,000	20,344,000.00	6.66
3	1282340	12 巨化 MTN1	200,000	20,124,000.00	6.59
4	041662002	16 沪世茂 CP001	200,000	20,108,000.00	6.58
5	041662016	16 芭田生态 CP001	200,000	20,082,000.00	6.57

### 8.7 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。

### 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投资。

### 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投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	6,454.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,064,569.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,071,023.70

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.12.6 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。

## § 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

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	221	787,434.43	155,578,795.81	89.40%	18,444,213.14	10.60%
中金纯债 C	101	1,046,344.76	99,264,247.23	93.93%	6,416,573.55	6.07%
合计	322	868,645.43	254,843,043.04	91.11%	24,860,786.69	8.89%

### 9.3 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	1,989.92	0.0011%
	中金纯债 C	3,872.43	0.0037%
	合计	5,862.35	0.0021%

### 9.4 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	0
	中金纯债 C	0~10
	合计	0~10
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

## § 10 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	104,230,372.17	43,121,889.95
本报告期基金总申购份额	273,964,335.00	103,392,666.72
减:本报告期基金总赎回份额	204,171,698.22	40,833,735.89
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	174,023,008.95	105,680,820.78

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内，本基金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

2016 年 1 月 6 日，根据中金基金股东中金公司股东决定，同意黄晓衡先生辞去中金基金独立董事职务，任命张龙先生为中金基金第一届董事会独立董事。

本报告期内，公司无董事长、法定代表人、其他高级管理人员和执行监事变动情况。

基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 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。本基金本报告期内应支付审计费用 80,000.00 元。

### 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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查和处罚。

### 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，交易设施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，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。

### 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	271,879,932.21	100.00%	1,939,200,000.00	100.00%	-	-

2017 年 3 月 31 日