

---

# 创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金

## 2020 年年度报告

2020 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:2021 年 03 月 30 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2021年03月26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2020年01月01日起至2020年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	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	50
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	50
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	50
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
8.12 投资组合报告附注.....	50
§9 基金份额持有人信息.....	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	52
§10 开放式基金份额变动.....	52
§11 重大事件揭示.....	52
11.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
11.4 基金投资策略的改变.....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
11.8 其他重大事件.....	55
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	56
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§13 备查文件目录.....	57
13.1 备查文件目录.....	57
13.2 存放地点.....	57
13.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金
基金简称	创金合信尊隆纯债
基金主代码	004322
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年02月10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	193,564,076.40份
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	0755-23838944
	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（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	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	缪建民

## 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.cjhxfund.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层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
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层

## § 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	2020年	2019年	2018年
本期已实现收益	6,606,548.66	7,243,459.96	8,222,671.03
本期利润	3,897,946.70	6,775,079.73	10,938,527.34
加权平均基金份额本期利润	0.0201	0.0350	0.0552

本期加权平均净值利润率	1.85%	3.29%	5.38%
本期基金份额净值增长率	1.89%	3.34%	5.59%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2020年末	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	9,235,270.93	15,223,398.75	7,981,066.56
期末可供分配基金份额利润	0.0477	0.0786	0.0412
期末基金资产净值	202,799,347.33	209,515,508.07	202,759,730.53
期末基金份额净值	1.0477	1.0824	1.0474
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2020年末	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	13.94%	11.83%	8.22%

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。

## 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

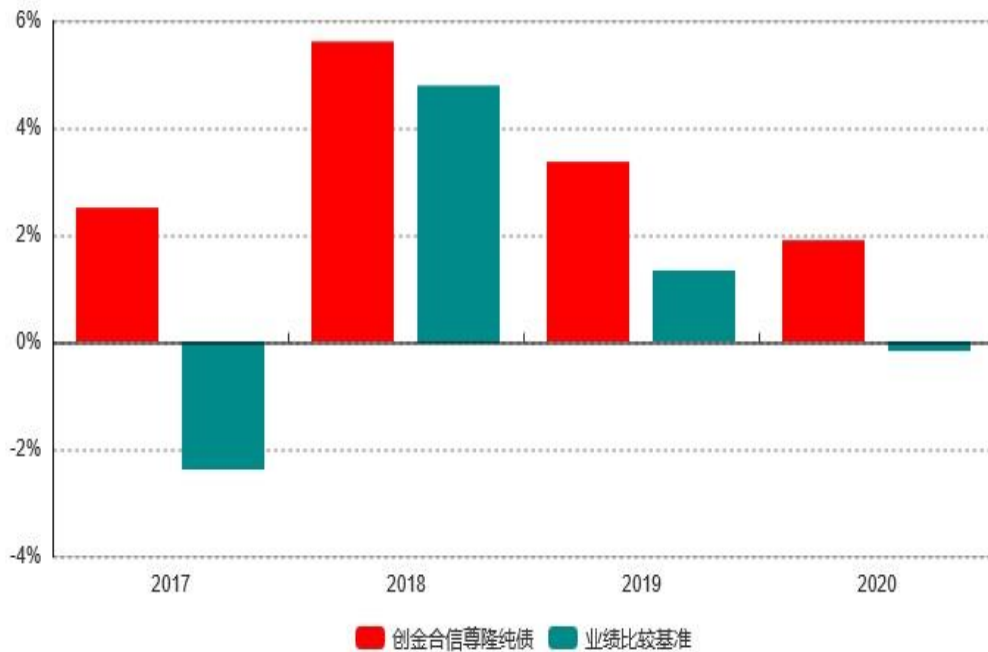
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.59%	0.04%	0.64%	0.04%	-0.05%	0.00%
过去六个月	0.67%	0.06%	-0.85%	0.07%	1.52%	-0.01%
过去一年	1.89%	0.06%	-0.06%	0.09%	1.95%	-0.03%
过去三年	11.17%	0.04%	6.09%	0.07%	5.08%	-0.03%
自基金合同生效起至今	13.94%	0.04%	3.58%	0.07%	10.36%	-0.03%

### 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

创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年02月10日-2020年12月31日)



### 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
2020年	0.548	10,607,304.60	6.23	10,607,310.83	-
2018年	0.332	13,067,412.23	272.41	13,067,684.64	-
合计	0.880	23,674,716.83	278.64	23,674,995.47	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月3日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册成立，注册地为深圳市。公司注册资本2.33亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例51.0729%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例21.8884%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例4.50645%。

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20只公募基金。截至2020年12月31日，本公司共管理61只公募基金，其中混合型产品16只、指数型产品5只、债券型产品22只、股票型产品17只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约436.47亿元。

#### 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	说明
		任职	离任		

		日期	日期	年限	
郑振源	本基金基金经理	2017-02-10	-	11年	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日期；

2、证券从业年限的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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与异常交易管理制度》，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，合规与风险管理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，公平交易制度总体执行情况良好。

### 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

2020年债券市场大幅波动，1-4月利率水平大幅下行，5月之后大幅上行。新冠疫情是去年行情变化的主线。1-4月阶段：1月底新冠疫情爆发及3月海外疫情蔓延，国内封城等严厉防控措施出台，经济活动总体出现停摆并大幅下挫，逆周期政策启动，财政政策积极并额外发行一万亿特别国债，货币政策利率明显下行，隔夜回购利率最低到1%以内，债券市场利率跟随大幅下行，10年国债最低至2.5%左右；5月之后，国内疫情得控，海外疫情严重，国内经济活动快速恢复，尤其是生产和投资活动，基于防风险诉求的货币政策开始转向，回购利率重新向常态水平回归，债券市场利率重新大幅上行。回购利率回归到政策利率以上，10年国债利率最高达到3.3%。此外，7月股市大幅上涨、8-9月国债供给压力导致一级市场、11月产业国企永煤违约等，都加剧了债券市场的上行压力。直到11月底金稳会定调维稳债券市场，央行重新引导货币市场利率下行，债券市场获得短期喘息。信用债则在永煤事件之后，出现持续性的信用分化表现。

报告期内，本基金秉承稳健的投资风格，注重票息策略，灵活调整久期，严控信用风险，同时在回购利率整体稳定的环境下，适当增加杠杆获取套息收益。此外，根据基金自身特性，做好信用债的信用分布，平衡好收益性、安全性和流动性，有效满足组合自身的流动性需求。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信尊隆纯债基金份额净值为1.0477元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.89%，同期业绩比较基准收益率为-0.06%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向前看，2021年债券市场震荡下行的概率仍较大，信用分化仍将延续。宏观经济方面，疫情对中国出口和低端消费的影响仍在延续，但预计不会导致今年中国经济有明显的变化；在防风险的融资约束下，房地产表现今年将较2020年有所转弱，基建投资也将维持偏弱，但考虑政策的连续稳定性，这种弱势出现大幅恶化的概率较低。因此，2021年中国经济预计仍在向潜在增速复苏的路径上，过热的风险相对较低。货币政策方面，2020年中央经济会议定调，政策需维持连续性、稳定性和可持续性，不急转弯，并保持对经济恢复的支持力度，从基调上来说，货币政策总体是中性的，不会有大松大紧的波动，边际变化仍看经济表现和防风险之间调整。对于债券市场而言，预计震荡幅度总体较2020年明显降低，在经济表现总体可能转弱的环境下，利率有一定的下行空间。信用方面，市场化改革方向决定未来产业国企的违约方向未变，而由于融资总体仍处于收缩状态，低等级城投仍存在可能的点状风险事件。

本基金将继续结合宏观政策形势变化，适时进行久期调节，注重票息收益，严控信用风险，力争为投资者赚取良好的投资回报。

#### 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。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《公平交易与异常交易管理制度》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、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 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10,607,310.83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

本报告期内，本基金已出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人的情形，该情形发生的时间范围为2020年06月19日至2020年08月11日。

### § 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：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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、投资组合报告内容真实、准确，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	普华永道中天审字(2021)第24974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	创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金(以下简称“创金合信尊隆纯债债券基金”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了创金合信尊隆纯债债券基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于创金合信尊隆纯债债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-

其他信息	-
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>创金合信尊隆纯债债券基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、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。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估创金合信尊隆纯债债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算创金合信尊隆纯债债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督创金合信尊隆纯债债券基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制,以</p>



	<p>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。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对创金合信尊隆纯债债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致创金合信尊隆纯债债券基金不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	郭素宏、李崇
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
审计报告日期	2021-03-29

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
----	-----	--------------------	---------------------

<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,358,815.59	3,151,055.20
结算备付金		719,133.37	-
存出保证金		2,028.31	-
交易性金融资产	7.4.7.2	249,308,300.00	241,113,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		249,308,300.00	231,113,000.00
资产支持证券投资		-	10,000,000.00
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	4,636,955.69	3,527,663.07
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		257,025,232.96	247,791,718.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019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		53,899,523.65	37,999,781.00
应付证券清算款		1,314.03	-
应付赎回款		-	216.32
应付管理人报酬		51,408.08	53,205.62
应付托管费		17,136.02	17,735.21

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,103.10	8,376.02
应交税费		26,625.86	5,444.06
应付利息		39,774.89	2,451.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	184,000.00	189,000.00
负债合计		54,225,885.63	38,276,210.20
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	193,564,076.40	193,570,088.72
未分配利润	7.4.7.10	9,235,270.93	15,945,419.35
所有者权益合计		202,799,347.33	209,515,508.07
负债和所有者权益总计		257,025,232.96	247,791,718.27

注：报告截止日2020年12月31日，基金份额净值1.0477元，基金份额总额193,564,076.40份。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
<b>一、收入</b>		6,114,002.62	8,732,563.32
1. 利息收入		10,034,071.29	9,577,328.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	22,824.37	29,391.66
债券利息收入		9,784,481.69	9,291,232.48
资产支持证券利息收入		214,752.24	251,268.04
买入返售金融资产收入		12,012.99	5,435.88

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,211,494.90	-376,406.75
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	-1,211,494.90	-376,406.75
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
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	-2,708,601.96	-468,380.23
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	28.19	22.24
<b>减：二、费用</b>		2,216,055.92	1,957,483.59
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	633,212.40	617,682.90
2. 托管费	7.4.10.2. 2	211,070.89	205,894.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	9,113.30	5,400.00
5. 利息支出		1,117,450.46	892,045.07
其中：卖出回购金融资产 支出		1,117,450.46	892,045.07
6. 税金及附加		22,254.75	10,127.21
7. 其他费用	7.4.7.19	222,954.12	226,334.10
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		3,897,946.70	6,775,079.73

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,897,946.70	6,775,079.73

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020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）	193,570,088.72	15,945,419.35	209,515,508.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,897,946.70	3,897,946.70
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）	-6,012.32	-784.29	-6,796.61
其中：1. 基金申购款	26,060.50	2,463.97	28,524.47
2. 基金赎回款	-32,072.82	-3,248.26	-35,321.08
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）	-	-10,607,310.83	-10,607,310.83
五、期末所有者权益（基金净值）	193,564,076.40	9,235,270.93	202,799,347.33

项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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)	193,588,194.66	9,171,535.87	202,759,730.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,775,079.73	6,775,079.73
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)	-18,105.94	-1,196.25	-19,302.19
其中：1. 基金申购款	18,739.29	1,284.66	20,023.95
2. 基金赎回款	-36,845.23	-2,480.91	-39,326.14
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)	193,570,088.72	15,945,419.35	209,515,508.07

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

沈琼

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

创金合信尊隆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”)证监许可[2016]1855号《关于准予创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信尊隆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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,052,050.53元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第117号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金基金合同》于2017年2月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,068,051.53份基金份额,其中认购资金利息折合16,001.00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”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、商业银行次级债、中期票据、短期融资券及超级短期融资券、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、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、国债期货等,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)。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终,在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。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

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至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。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。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。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证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。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。



金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于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

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 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；(2) 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；(3) 每一基金份额享有同等分配权；(4) 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；(5) 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) 本基金的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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 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：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确

全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	2,358,815.59	3,151,055.20
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	2,358,815.59	3,151,055.20

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020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	38,098,367.02	37,403,300.00	-695,067.02
	银行间市场	213,200,690.10	211,905,000.00	-1,295,690.10
	合计	251,299,057.12	249,308,300.00	-1,990,757.12
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		251,299,057.12	249,308,300.00	-1,990,757.12
项目		上年度末2019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	-	-	-
	银行间市场	230,395,155.16	231,113,000.00	717,844.84
	合计	230,395,155.16	231,113,000.00	717,844.84
资产支持证券		10,000,000.00	10,000,000.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		240,395,155.16	241,113,000.00	717,844.84

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	376.00	847.50
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	355.96	-
应收债券利息	4,636,222.74	3,268,010.09
应收资产支持证券利息	-	258,805.48
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	0.99	-
合计	4,636,955.69	3,527,663.07

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019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	6,103.10	8,376.02
合计	6,103.10	8,376.02

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	184,000.00	189,000.00
合计	184,000.00	189,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	193,570,088.72	193,570,088.72
本期申购	26,060.50	26,060.50
本期赎回（以“-”号填列）	-32,072.82	-32,072.82
本期末	193,564,076.40	193,564,076.40

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

## 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
上年度末	15,223,398.75	722,020.60	15,945,419.35
本期利润	6,606,548.66	-2,708,601.96	3,897,946.70
本期基金份额交易产生的变动数	-759.18	-25.11	-784.29
其中：基金申购款	2,283.61	180.36	2,463.97
基金赎回款	-3,042.79	-205.47	-3,248.26
本期已分配利润	-10,607,310.83	-	-10,607,310.83
本期末	11,221,877.40	-1,986,606.47	9,235,270.93

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	18,574.88	29,391.66
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	4,228.57	-
其他	20.92	-
合计	22,824.37	29,391.66

## 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

## 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 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	-1,211,494.90	-376,406.75
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	-1,211,494.90	-376,406.75

## 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 2020年01月01日至2020年12月	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月
----	----------------------------	---------------------------------



	31日	31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	357,716,364.97	296,629,167.11
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	351,839,070.28	289,665,966.75
减：应收利息总额	7,088,789.59	7,339,607.11
买卖债券差价收入	-1,211,494.90	-376,406.75

#### 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 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
卖出资产支持证券成交总额	10,382,947.95	-
减：卖出资产支持证券成本总额	10,000,000.00	-
减：应收利息总额	382,947.95	-
资产支持证券投资收益	-	-

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
1. 交易性金融资产	-2,708,601.96	-468,380.23
——股票投资	-	-
——债券投资	-2,708,601.96	-468,380.23
——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	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	-2,708,601.96	-468,380.23

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	28.19	22.24
合计	28.19	22.24

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	288.30	-
银行间市场交易费用	8,825.00	5,400.00

合计	9,113.30	5,400.00
----	----------	----------

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	55,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	10,754.12	9,134.10
账户维护费	36,000.00	36,000.00
查询服务费	1,200.00	1,200.00
合计	222,954.12	226,334.10

#### 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，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

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
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
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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
第一创业 证券股份 有限公司	58,429,887.56	100.00%	-	-

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的

		比例		比例
第一创业 证券股份 有限公司	826,600,000.00	100.00%	-	-

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末及上年度末均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 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	633,212.40	617,682.90
其中：支付销售机构的客户维护费	19.87	34.97

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	211,070.89	205,894.31

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的转融通出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的转融通出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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
招商银行 股份有限	2,358,815.59	18,574.88	3,151,055.20	29,391.66

公司				
----	--	--	--	--

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业存款利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金**

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	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2020-11-26	2020-11-26	0.548	10,607,304.60	6.23	10,607,310.83	-
合计			0.548	10,607,304.60	6.23	10,607,310.83	-

**7.4.12 期末(2020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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有股票。

**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2020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50,899,523.65元,是以如下债券作为抵押:

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
012003172	20豫交运SCP003	2021-01-08	99.74	100,000	9,974,000.00
101756043	17吴中经发MTN002	2021-01-04	104.30	50,000	5,215,000.00
101756043	17吴中经发MTN002	2021-01-08	104.30	25,000	2,607,500.00
101900466	19涪陵国资MTN001	2021-01-04	102.99	70,000	7,209,300.00
101900523	19晋交投MTN001	2021-01-04	103.74	100,000	10,374,000.00
102000710	20南京浦口MTN002	2021-01-08	98.33	100,000	9,833,000.00
102001014	20闽建工MTN001	2021-01-08	98.18	100,000	9,818,000.00
合计				545,000	55,030,800.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年12月31日止，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3,000,000.00元，于2021年01月04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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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金融工具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、合规与风险管理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和债券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（场内）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，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	10,034,000.00
A-1以下	-	-
未评级	42,028,800.00	10,016,000.00
合计	42,028,800.00	20,050,000.00

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	38,935,000.00

合计	-	38,935,000.00
----	---	---------------

#### 7.4.13.2.3 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	30,526,000.00	40,249,000.00
AAA以下	166,704,500.00	20,243,000.00
未评级	10,049,000.00	111,636,000.00
合计	207,279,500.00	172,128,000.00

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	10,000,000.00
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	10,000,000.00

#### 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。

于2020年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有53,899,523.65元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不付息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持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,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2020年12月31日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.00%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2020年12月31日,本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为256,303,338.33元,超过经确认的当日净赎回金额。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020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	2,358,815.59	-	-	-	2,358,815.59
结算备付金	719,133.37	-	-	-	719,133.37
存出保证金	2,028.31	-	-	-	2,028.31
交易性金融资产	147,811,300.00	101,497,000.00	-	-	249,308,300.00
应收利息	-	-	-	4,636,955.69	4,636,955.69
资产总计	150,891,277.27	101,497,000.00	-	4,636,955.69	257,025,232.96
负债					
卖出回购金融资产款	53,899,523.65	-	-	-	53,899,523.65
应付证券清算款	-	-	-	1,314.03	1,314.03
应付管理人报酬	-	-	-	51,408.08	51,408.08

应付托管费	-	-	-	17,136.02	17,136.02
应付交易费用	-	-	-	6,103.10	6,103.10
应交税费	-	-	-	26,625.86	26,625.86
应付利息	-	-	-	39,774.89	39,774.89
其他负债	-	-	-	184,000.00	184,000.00
负债总计	53,899,523.65	-	-	326,361.98	54,225,885.63
利率敏感度缺口	96,991,753.62	101,497,000.00	-	4,310,593.71	202,799,347.33
上年度末2019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	3,151,055.20	-	-	-	3,151,055.20
交易性金融资产	119,556,000.00	121,557,000.00	-	-	241,113,000.00
应收利息	-	-	-	3,527,663.07	3,527,663.07
资产总计	122,707,055.20	121,557,000.00	-	3,527,663.07	247,791,718.27
负债					
卖出回购金融资产款	37,999,781.00	-	-	-	37,999,781.00
应付赎回款	-	-	-	216.32	216.32
应付管理人报酬	-	-	-	53,205.62	53,205.62
应付托管费	-	-	-	17,735.21	17,735.21
应付交易费用	-	-	-	8,376.02	8,376.02
应交税费	-	-	-	5,444.06	5,444.06
应付利	-	-	-	2,451.97	2,451.97

息					
其他负债	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	37,999,781.00	-	-	276,429.20	38,276,210.20
利率敏感度缺口	84,707,274.20	121,557,000.00	-	3,251,233.87	209,515,508.07

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

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
		市场利率上升25个基点	-699,709.16
市场利率下降25个基点	705,004.89	653,702.18	

#### 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

其他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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

##### 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

无

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

- (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2020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二层次的余额为249,308,300.00元，无属于第一层次和第三层次的余额（2019年12月31日：第二层次231,113,000.00元，第三层次10,000,000.00元，无第一层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间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

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

资产支持证券投资

2020年1月1日 10,000,000.00

购买 -

兑付 -10,000,000.00

出售 -

转入第三层级 -

转出第三层级 -

当期利得或损失总额 -

计入损益的利得或损失 -

2020年12月31日 -

2020年12月31日仍持有的资产计入2020年度损益的未实现利得或损失的变动

—公允价值变动损益

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

第三层次资产为在交易所挂牌转让的资产支持证券。根据中国证券投资基金业协会发布的《关于发布〈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〉的通知》，本基金管理人认为上述资产支持证券的成本能够近似体现公允价值，因此上述资产支持证券公允价值根据成本确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020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(2019年12月31日：同)。

(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。

(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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	249,308,300.00	97.00
	其中：债券	249,308,300.00	97.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,077,948.96	1.20
8	其他各项资产	4,638,984.00	1.80
9	合计	257,025,232.96	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

本基金本报告期内未持有股票。

##### 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

本基金本报告期内未持有股票。

##### 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持有股票。

#### 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	1,999,800.00	0.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,138,000.00	9.93
	其中：政策性金融债	10,049,000.00	4.96
4	企业债券	35,403,500.00	17.46
5	企业短期融资券	40,029,000.00	19.74
6	中期票据	151,738,000.00	74.82
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	249,308,300.00	122.93

#### 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	112470	16江控01	150,000	15,013,500.00	7.40
2	101756043	17吴中经发MTN 002	100,000	10,430,000.00	5.14
3	127823	18城北01	100,000	10,429,000.00	5.14
4	101900523	19晋交投MTN00 1	100,000	10,374,000.00	5.12
5	101900466	19涪陵国资MTN 001	100,000	10,299,000.00	5.08

#### 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

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。

#### 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

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

## 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	2,028.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,636,955.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,638,984.00

## 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。

## § 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)	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
201	963,005.36	193,553,663.02	99.99%	10,413.38	0.01%

## 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	6,151.85	0.00%
------------------	----------	-------

### 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(2017年02月10日)基金份额总额	200,068,051.53
本报告期期初基金份额总额	193,570,088.72
本报告期基金总申购份额	26,060.50
减：本报告期基金总赎回份额	32,072.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	193,564,076.40

## § 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

自2020年7月27日起，奚胜田先生担任创金合信基金管理有限公司副总经理。

自2020年8月28日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 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，未出现涉及基金管理人、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,本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用55,000.00元,该审计机构连续提供审计服务的年限为4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,未出现管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

## 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
英大证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
招商	2	-	-	-	-	-

证券						
中金 财富 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 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。

本基金报告期内新增中金财富证券和华安证券的4个交易单元，退租广发证券的2个交易单元。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	58,429,887.56	100.00%	826,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

光大证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财 富证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证 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	创金合信尊隆纯债债券型证 券投资基金2019年第四季度 报告	公司官网、中国证监会基金 电子披露网站	2020-01-17
2	创金合信基金管理有限公司 关于调整旗下部分产品申购 金额下限及最低持有份额下 限的公告	公司官网、中国证券报、中 国证监会基金电子披露网站	2020-02-03
3	创金合信基金管理有限公司 关于延期披露旗下公募基金 2019年年度报告的公告	公司官网、中国证券报、中 国证监会基金电子披露网站	2020-03-25
4	创金合信基金管理有限公司 关于旗下部分基金在直销渠 道实施费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中 国证监会基金电子披露网站	2020-04-17
5	创金合信尊隆纯债债券型证 券投资基金2020年第一季度 报告	公司官网、中国证监会基金 电子披露网站	2020-04-21
6	创金合信基金管理有限公司 关于直销柜台银行账户信息 的提示性公告	公司官网、中国证券报	2020-04-29
7	创金合信尊隆纯债债券型证	公司官网、中国证监会基金	2020-04-30

	券投资基金2019年年度报告	电子披露网站	
8	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道实施费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-15
9	创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金2020年第二季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-21
10	创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金2020年中期报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-08-31
11	创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金2020年资料概要更新	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-09-01
12	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道实施费率优惠的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-10-16
13	创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金（2020年10月）招募说明书（更新）	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-10-24
14	创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金2020年第三季度报告	公司官网、中国证监会基金电子披露网站	2020-10-28
15	创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-11-19
16	创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金分红公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2020-11-24

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比



别							
机构	1	20200101 - 20201231	193,553,663.02	0.00	0.00	193,553,663.02	99.99%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1、大额申购风险 在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、大额赎回风险</p> <p>(1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；</p> <p>(2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响；</p> <p>(3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；</p> <p>(4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，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、《创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信尊隆纯债债券型证券投资基金 2020 年年度报告原文。

### 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

创金合信基金管理有限公司  
二〇二一年三月三十日