

创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金 2017年第1季度报告 2017年3月31日

创金合信尊享纯债债券型证券投资基金 2017年第1季度报告 2017年3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:兴业银行股份有限公司 报告送出日期:2017年4月21日

§1 重要提示 基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:截至报告期末,本基金仍处于建仓期内。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明

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,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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度债券市场收益率在去年底下修的基础上,重新出现整体上行。货币政策的进一步收紧是主要因素。一方面,短期经济继续呈现偏弱的状态,其中房地产行业投资维持惯性较高增速,而基建投资在PPP落地加快推动下,较去年下半年增速有明显提升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017年第一季度创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金净值增长率为0.33%,同期业绩比较基准增长率为-1.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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,或在编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金未投资于股票。

5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 报告期初基金份额总额, 报告期末基金份额总额

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

Table with 2 columns: 投资者类别, 报告期末持有基金份额情况

本基金在报告期内,存在报告期末单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形,可能会存在以下风险:

1. 大额申购赎回风险: 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准备,则可能降低基金净值涨幅。

2. 大额赎回风险: (1)若本基金在短期内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

3. 基金资产净值波动风险: (1)若基金资产净值波动较大,可能导致基金净值有较大波动;

4. 流动性风险: (1)若基金资产净值波动较大,可能导致基金净值有较大波动;

5. 基金资产净值波动风险: (1)若基金资产净值波动较大,可能导致基金净值有较大波动;

6. 基金资产净值波动风险: (1)若基金资产净值波动较大,可能导致基金净值有较大波动;

7. 基金资产净值波动风险: (1)若基金资产净值波动较大,可能导致基金净值有较大波动;

8. 基金资产净值波动风险: (1)若基金资产净值波动较大,可能导致基金净值有较大波动;

9. 基金资产净值波动风险: (1)若基金资产净值波动较大,可能导致基金净值有较大波动;

10. 基金资产净值波动风险: (1)若基金资产净值波动较大,可能导致基金净值有较大波动;

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 报告送出日期:2017年4月21日

§1 重要提示 基金管理人的董事会及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责任。

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4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

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,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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度债券市场收益率在去年底下修的基础上,重新出现整体上行。货币政策的进一步收紧是主要因素。一方面,短期经济继续呈现偏弱的状态,其中房地产行业投资维持惯性较高增速,而基建投资在PPP落地加快推动下,较去年下半年增速有明显提升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017年第一季度创金合信尊享纯债债券型证券投资基金净值增长率为-0.40%,同期业绩比较基准增长率为-1.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 报告送出日期:2017年4月21日

§1 重要提示 基金管理人的董事会及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责任。

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4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

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,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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度债券市场收益率在去年底下修的基础上,重新出现整体上行。货币政策的进一步收紧是主要因素。一方面,短期经济继续呈现偏弱的状态,其中房地产行业投资维持惯性较高增速,而基建投资在PPP落地加快推动下,较去年下半年增速有明显提升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017年第一季度创金合信尊享纯债债券型证券投资基金净值增长率为-0.40%,同期业绩比较基准增长率为-1.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)