

中融恒泰纯债债券型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:中融基金管理有限公司 基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 30 日

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金简称, 基金代码, etc. Details about the fund's basic information.

2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, etc. Details about the fund's investment objectives and strategies.

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 3 columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人. Details about the fund manager and custodian.

2.4 信息披露方式

Table with 2 columns: 基金年度报告备置地点, 基金管理人及基金托管人住所. Disclosure information.

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

Table with 4 columns: 指标, 2017 年, 2016 年 12 月 27 日, etc. Financial performance indicators.

注:1. 所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...

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

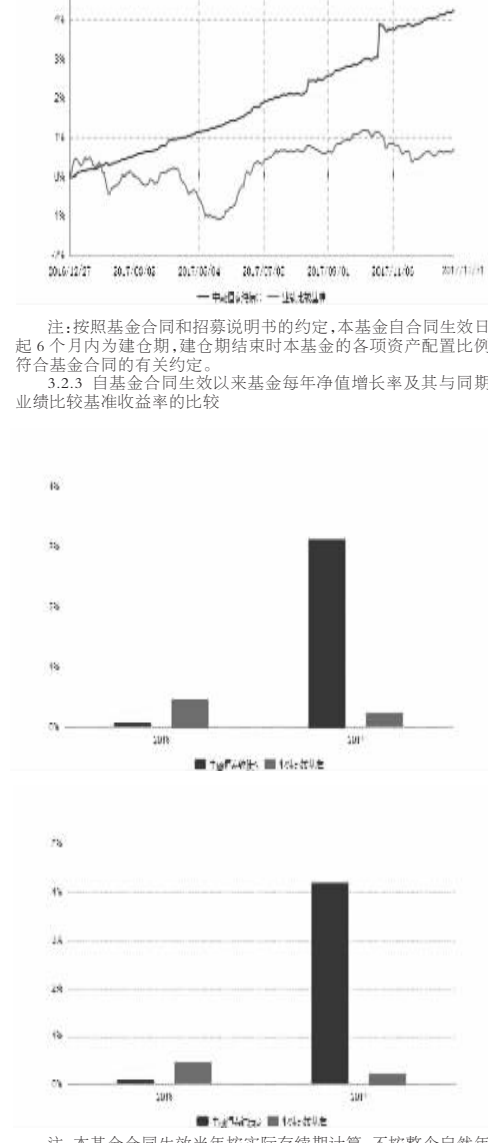
Table with 4 columns: 阶段, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc. Comparison of fund performance to benchmark.

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



注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期...

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



注:本基金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

中融恒泰纯债 A 单位:人民币元

Table with 5 columns: 年度, 每 10 份基金份额派发红利, 基金形式发放总收益, etc. Dividend distribution details.

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其基金经理的情况 本基金管理人为中融基金管理有限公司,成立于 2013 年 5 月 31 日...

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理(助理)期限, 说明. Details about the fund manager and assistants.

注:(1)上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

(2)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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规...

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和内部控制

公司制定了《公平交易管理制度》,按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》等法律法规的规定...

4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易管理制度指导意见》,本公司制定了《公平交易管理制度》并严格执行...

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。

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

2017 年金融防风险政策延续,货币政策中性略紧,央行对资金面精准把握,资金面波动风险与分层现象继续...

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融恒泰纯债 A 基金份额净值为 1.0037 元;本报告期内,基金份额净值增长率为 3.15%,同期业绩比较基准收益率为 0.24%...

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 2018 年,全球国内经济不确定性增强,通胀压力抬头,美联储预计至少加息 2 次...

4.6 管理人内部有关基金基金的投资决策程序

本报告期内,本基金管理人在内部投资决策工作中,一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发...

4.7 报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的规定...

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的收益分配原则:本基金收益分配方式为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相应类别的基金份额进行再投资...

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

本报告期内,中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在中融恒泰纯债债券型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规...

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督...

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 审计报告

6.1 审计报告的基本内容

Audit report table with columns: 审计意见类型, 审计报告文号, 审计日期, etc. Audit details.

审计报告

审计报告日期:2018 年 03 月 22 日

6.2 审计报告的基本内容

Audit report table with columns: 审计意见类型, 审计报告文号, 审计日期, etc. Audit details.

1,995,618,775.98 份。其中 A 类基金份额净值 1.0037 元,基金份额总额 1,995,174,401.06 份;C 类基金份额净值 1.0242 元,基金份额总额 444,374.92 份。

7.2 利润表

会计主体:中融恒泰纯债债券型证券投资基金 本报告期:2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日 单位:人民币元

Profit and Loss Statement table with columns: 项目, 附注, 本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日, etc. Financial data.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中融恒泰纯债债券型证券投资基金 本报告期:2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日 单位:人民币元

Equity Statement table with columns: 项目, 2017 年 01 月 01 日, 本期 2017 年 12 月 31 日, etc. Financial data.

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金会本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 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。

7.4.3 关联方关系

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关系. List of related parties.

7.4.4 通过关联方交易单元进行的关联交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的关联交易 无。

7.4.4.2 权证交易

无。

7.4.4.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.4.4 债券回购交易

无。

7.4.4.5 关联方报酬

7.4.4.5.1 基金管理人报酬 单位:人民币元

Table with 3 columns: 项目, 本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日, 上年度可比期间 2016 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日. Compensation details.

注: ①支付给基金管理人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。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

(下转 D340 版)