

创金合信聚利债券型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 03 月 26 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 23 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 5 月 15 日（基金合同生效日）起至 2015 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	创金合信聚利债券	
基金主代码	001199	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年05月15日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	160,464,845.14份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金聚利A级	创金聚利C级
下属分级基金的交易代码	001199	001200
报告期末下属分级基金的份 额总额	123,245,595.19份	37,219,249.95份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过对宏观经济以及债券市场中长期发展趋势的客观判断，合理配置风险收益较优的企业债、公司债，以及可转换债、可分离债券等，加以对国家债券等高流动性品种的投资，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略。在保证基金流动性的前提下，积极把握投资机会，获取各类债券的超额投资收益。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	洪渊
	联系电话	0755-23838908	010-66105799
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-868-0666	95588
传真		0755-25832571	010-66105798

## 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	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

## § 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	2015 年 05 月 15 日-2015 年 12 月 31 日	2015 年 05 月 15 日-2015 年 12 月 31 日
	创金聚利 A 级	创金聚利 C 级
本期已实现收益	10,138,275.50	2,665,847.49
本期利润	11,960,111.24	3,302,058.08
加权平均基金份额本期利润	0.0623	0.0643
本期基金份额净值增长率	7.00%	6.70%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0590	0.0564
期末基金资产净值	131,836,849.30	39,715,178.93
期末基金份额净值	1.070	1.067

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,表中的“期末”均指报告期最后一日,即 2015 年 12 月 31 日。
4. 本基金合同生效日为 2015 年 5 月 15 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 (创金聚利 A 级)	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	4.70%	0.18%	3.27%	0.17%	1.43%	0.01%
过去六个月	7.11%	0.20%	1.22%	0.27%	5.89%	-0.07%
自基金合同生效日起至今(2015 年 05 月 15 日-2015 年 12 月 31 日)	7.00%	0.30%	0.60%	0.28%	6.40%	0.02%

阶段 (创金聚利 C 级)	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	4.51%	0.19%	3.27%	0.17%	1.24%	0.02%
过去六个月	6.91%	0.20%	1.22%	0.27%	5.69%	-0.07%
自基金合同生效日起至今(2015 年 05 月 15 日-2015 年 12 月 31 日)	6.70%	0.31%	0.60%	0.28%	6.10%	0.03%

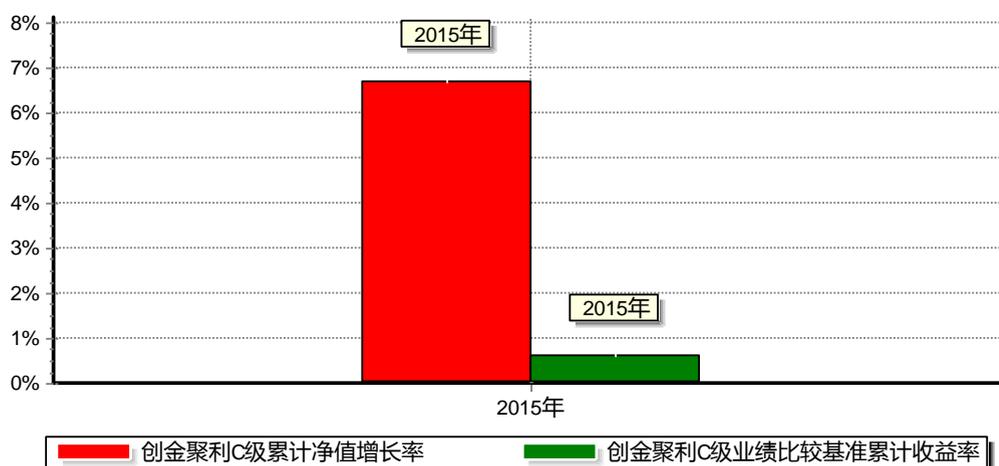
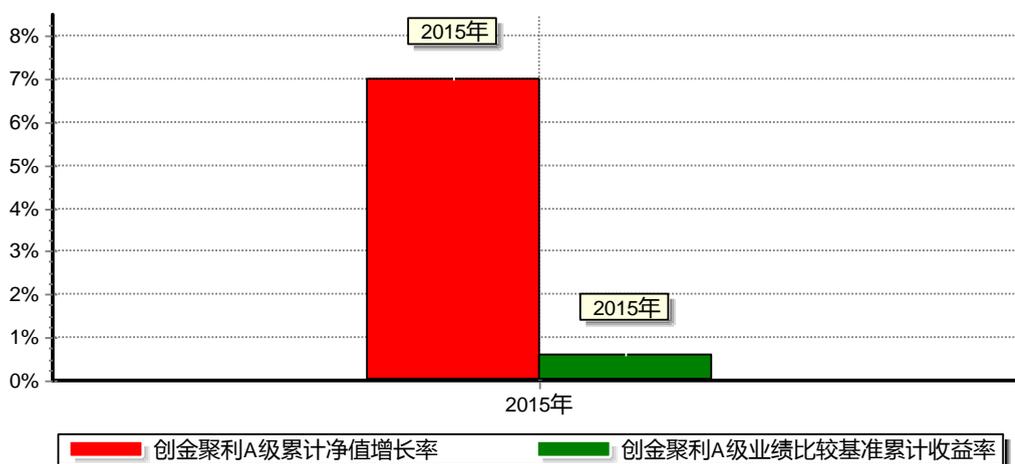
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同于 2015 年 5 月 15 日生效。

2、根据本基金基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

### 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：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

本基金自基金合同生效日（2015年5月15日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 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

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 7 只公募基金。截至 2015 年 12 月 31 日，本公司共管理 7 只公募基金，其中混合型产品 3 只、指数型产品 2 只、债券型产品 1 只和货币型产品 1 只；管理的公募基金规模为 44.22 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	本基金基金经理、固定收益部总监	2015 年 05 月 15 日	—	11	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	本基金基金经理	2015 年 05 月 15 日	—	6	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。
张荣	本基金基金经理	2015年06月11日	—	5	张荣先生，中国国籍，北京大学金融学硕士。2004年就职于深圳银监局从事银行监管工作，历任多家银行监管员。2010年加入第一创业证券资产管理部，历任金融行业研究主管、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担任高级研究员。

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。

3、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、《创金合信聚利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

所有投资对象的投资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

本报告期内, 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)》, 完善相应制度及流程, 通过系统和人工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。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

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

总体来说，2015 年的债券市场延续了牛市的格局。经济偏弱及央行货币政策宽松奠定了牛市的基础，在债券供给、财政刺激及股市等因素的作用下，收益率呈现震荡加剧、波动加大的态势。

上半年，短端利率的变化经历两个阶段：一季度，调结构在央行的目标权重较大，货币市场利率整体维持偏高，短端收益率居高不下，而随着经济下行压力加大，二季度，央行稳增长需求推动宽松力度有所加大，货币市场利率开始出现趋势性下行，短端收益率也跟随大幅下行。长端利率则在上半年维持震荡格局，经济下行压力推动长债收益率下行，但 3 月地方债置换所带来的地方债大幅供给，以及二季度政府不断释放稳增长预期，构成长债的上行动力。

下半年，短端利率整体维持相对稳定，主要是央行持续维护货币市场利率的稳定，7 天回购利率稳定在 2.4% 附近，因此短端品种的收益率整体变化不大。负面冲击包括以下：一是 7 月股灾及 11 月 IPO 的重启构成了短期扰动，二是低评级品种面临信用利差持续扩大的局面。11 月山水水泥的信用事件，虽然只是今年以来企业违约风险事件的其中之一，但对低评级短融市场构成了较为明显的冲击，尤其是中央开始准备对产能过剩行业加大清理力度的情况下。

长端方面，整体呈现趋势下行的牛市行情。两个因素发挥了决定性作用：一方面，财政刺激无力。从二季度开始，政府开始不断推出稳增长措施，但由于考核机制转变，财政刺激的效果大幅减弱；其次，下半年，注重调结构、促改革的增长思路重新成为政府主要着力，来自刺激的扰动进一步减弱。对于经济增长而言，投资需求减弱，经济下行，推动利率下行。另一方面，股灾后银行资产重配，在经济下行导致实体融资需求下降后，上半年股市上行为银行提供优先配资及打新等低风险高收益资产，股灾则使银行面临资产配置的紧缺，债市成为优先选择。上述两个因素主导了下半年的债市行情。而 11 月 IPO 重启及美联储加息，由于不构成实质影响，因此也只是短期冲击。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年创金聚利 A 级净值增长率 7.0%，创金聚利 C 级净值增长率为 6.70%，同期业绩比较基准增长率为 4.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央经济工作会议提出 2016 年要更加注重供给侧结构性改革，主要是抓好去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板五大任务，积极稳妥化解产能过剩、帮助企业降低成本、化解房地产库存、扩大有效供给、防范化解金融风险，并多次提及资本市场在其中承担重要使命。中央经济工作会议的总基调仍然是有托底的调结构而非全面刺激，而且要着力降低融资成本，奠定了长期资金宽松的格局。

对于财政政策而言，重点将从投资转向减税，最初的政策效果是传统产业需求疲弱，调整加速、出清加速。但随后就可能迎来企业盈利状况改善，进而带来企业投资增加、宏观逐步企稳。

对于货币政策而言，央行货币政策委员会第四季度例会表示将保持政策的连续性和稳定性，继续实施稳健的货币政策，更加注重松紧适度，适时适度预调微调，为经济结构调整与转型升级营造中性适度的货币金融环境。央行已明确宣示，货币政策将从数量型为主转向价格为主，这将降低短期利率的波动性。

预计 2016 年经济整体维持偏弱格局，央行货币政策将被动式宽松。因此，债市长牛的逻辑基础不变，收益率曲线长期下行仍将是市场主要趋势，但长短端债券可能呈现很不一致的下行走势。短期债券收益率主要受货币市场利率影响，随着货币市场稳定下行，短债收益率稳定下行是可以预期的。长债方面，随着收益率的低位下行，波动性会加大。

信用方面，供给侧改革市场加速出清，信用违约将会越发频繁。需要谨防信用利差在事件冲击下的急剧上升。

2016 年本基金将继续以利率债和高评级债券为主要投资品种，择机进行波段操作，同时规避中低评级产业债的信用风险，争取为持有人获取稳定的回报。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

结合法律法规的规定及《基金合同》的约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次该类基金份额可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 4.8 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

本报告期内，本基金托管人在对创金合信聚利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，创金合信聚利债券型证券投资基金的管理人——创金合信基金管理有限公司在创金合信聚利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，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

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的创金合信聚利债券型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对创金合信基金管理有限公司创金合信聚利债券型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 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出具了标准无保留意见（普华永道中天审字(2016)第 21124 号）。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：创金合信聚利债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>	
银行存款	28,052,291.07
结算备付金	237,678.66
存出保证金	57,925.15
交易性金融资产	193,936,600.70
其中：股票投资	16,826,824.00
基金投资	—
债券投资	177,109,776.70
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	—
应收利息	2,964,542.02
应收股利	—
应收申购款	500.00
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	225,249,537.60

负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日
<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	48,099,327.85
应付证券清算款	4,836,227.92
应付赎回款	291,485.77
应付管理人报酬	103,541.64
应付托管费	29,583.33
应付销售服务费	12,980.63
应付交易费用	212,130.78
应交税费	—
应付利息	9,116.05
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	103,115.40
负债合计	53,697,509.37
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	160,464,845.14
未分配利润	11,087,183.09
所有者权益合计	171,552,028.23
负债和所有者权益总计	225,249,537.60

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额总额 160,464,845.14 份，其中下属 A 类基金份额 123,245,595.19 份，C 类基金份额 37,219,249.95 份。下属 A 类基金份额净值 1.070 元，C 类基金份额净值 1.067 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 5 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：创金合信聚利债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 05 月 15 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2015 年 05 月 15 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	18,180,725.43
1. 利息收入	7,565,965.02
其中：存款利息收入	187,091.88
债券利息收入	7,137,522.88
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	241,350.26
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	8,057,633.38
其中：股票投资收益	5,299,429.21
基金投资收益	—
债券投资收益	2,381,426.35
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	376,777.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,458,046.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	99,080.70
<b>减：二、费用</b>	2,918,556.11
1. 管理人报酬	1,088,521.63
2. 托管费	311,006.25
3. 销售服务费	131,199.31

4. 交易费用	391,299.79
5. 利息支出	861,142.23
其中: 卖出回购金融资产支出	861,142.23
6. 其他费用	135,386.90
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	15,262,169.32
减: 所得税费用	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	15,262,169.32

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 创金合信聚利债券型证券投资基金

本报告期: 2015 年 05 月 15 日至 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	本期 2015 年 05 月 15 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)	385,546,708.18	—	385,546,708.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		15,262,169.32	15,262,169.32
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)	-225,081,863.04	-4,174,986.23	-229,256,849.27
其中: 1. 基金申购款	26,437,207.37	1,003,396.16	27,440,603.53
2. 基金赎回款	-251,519,070.41	-5,178,382.39	-256,697,452.80
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)	160,464,845.14	11,087,183.09	171,552,028.23

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

创金合信聚利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[2015]第 472 号《关于准予创金合信聚利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《创金合信聚利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 385,473,879.28 元,已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(2015)第 481 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信聚利债券型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 385,546,708.18 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,828.90 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信聚利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类资产及债券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)。本基金的业绩比较基准为:中债综合(全价)指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%。

本财务报表由本基金的基金管理人创金合信基金管理有限公司于 2016 年 3 月 24 日批准报出。

### 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<年度报告和半年度报告>》、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》、《创金合信聚利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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 5 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 5 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止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。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 5 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

#### 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股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入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

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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，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。

(2) 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，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。

(3) 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

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确认。

#### 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确认，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。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、托管费和销售服务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) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次该类基金份额

可供分配利润的 30%；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可对 A 类基金份额、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；选择采取红利再投资方式的，基金份额的分红金额将转为同一类别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为现金分红。(3) 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。(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案；同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。(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股票投资和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：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### 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[2012]85号《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 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。

#### 7.4.7 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司(“工商银	基金托管人、基金销售机构

行”)	
第一创业证券股份有限公司(“第一创业证券”)	基金管理人股东、基金销售机构
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年05月15日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
第一创业证券	283,892,586.41	100.00%

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金于本期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年05月15日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
第一创业证券	198,373.16	100.00%	198,373.16	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

##### 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 2015年05月15日至2015年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	1,088,521.63
其中:支付销售机构的客户维护费	756,918.30

注:支付基金管理人创金合信基金管理有限公司的管理人报酬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。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.70% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期
	2015 年 05 月 15 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	311,006.25

注:支付基金托管人中国工商银行的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。其计算公式为:

日托管费=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		
	2015 年 05 月 15 日至 2015 年 12 月 31 日		
	创金聚利 A 级	创金聚利 C 级	合计
工商银行	—	126,789.73	126,789.73
第一创业证券	—	37.04	37.04
合计		126,826.77	126,826.77

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金的基金资产净值 0.4% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给创金合信基金管理有限公司,再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=C 类基金前一日基金资产净值× 0.4%/ 当年天数。

#### 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

本基金于本期未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。

## 7.4.8.4.2 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

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。

## 7.4.8.5 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 2015年05月15日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	28,052,291.07	169,997.19

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按金融机构同业存款利率计息。

## 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

## 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

## 7.4.9 期末（2015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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
136087	15保利01	2015-12-11	2016-01-22	新发流通受限	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00

## 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌原因	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末
----	----	----	------	----	----	----	----	----	----

代码	名称	日期		估值单价	日期	开盘单价	(股)	成本总额	估值总额
002065	东华软件	2015-12-21	重大事项	25.10			1,000	22,250.00	25,100.00
600572	康恩贝	2015-12-28	重大事项	13.36	2016-01-04	13.18	15,000	189,000.00	200,400.00
600859	王府井	2015-12-21	重大事项	27.22	2016-01-04	27.22	11,000	279,400.00	299,420.00

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因重大事项可能产生重大影响被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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

截至本报告期末 2015 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 48,099,327.85 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
1382056	13 北车集 MTN1	2016-01-05	104.87	100,000	10,487,000.00
1382086	13 粤机场 MTN1	2016-01-04	104.56	100,000	10,456,000.00
1282156	12 中石油 MTN1	2016-01-06	102.51	100,000	10,251,000.00
041552045	15 黄山股 CP001	2016-01-08	100.19	100,000	10,019,000.00
041556052	15 大秦铁路 CP001	2016-01-07	100.41	100,000	10,041,000.00
合计				500,000	51,254,000.00

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本期末未持有交易所市场债券正回购。

#### 7.4.10 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 2015 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 16,301,904.00 元，属于第二层次的余额为 177,634,696.70 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）、或属于非公开发行等情况，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 2015 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。

(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	16,826,824.00	7.47
	其中：股票	16,826,824.00	7.47
2	固定收益投资	177,109,776.70	78.63
	其中：债券	177,109,776.70	78.63
	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	28,289,969.73	12.56
7	其他各项资产	3,022,967.17	1.34
8	合计	225,249,537.60	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	565,936.00	0.33
B	采矿业	—	—
C	制造业	13,218,180.00	7.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	18,685.00	0.01
F	批发和零售业	1,089,975.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	467,070.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	296,868.00	0.17
J	金融业	—	—
K	房地产业	887,110.00	0.52

L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	283,000.00	0.16
S	综合	—	—
	合计	16,826,824.00	9.81

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002029	七匹狼	38,000	519,460.00	0.30
2	600398	海澜之家	32,000	446,720.00	0.26
3	600594	益佰制药	19,000	402,800.00	0.23
4	002041	登海种业	23,000	387,550.00	0.23
5	002470	金正大	18,600	378,324.00	0.22
6	002675	东诚药业	6,200	347,262.00	0.20
7	600807	天业股份	19,000	328,890.00	0.19
8	600865	百大集团	15,000	322,050.00	0.19
9	300159	新研股份	19,000	315,400.00	0.18
10	600685	中船防务	7,800	309,582.00	0.18

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	6,583,620.00	3.84

2	000848	承德露露	6,357,620.00	3.71
3	000596	古井贡酒	6,266,938.00	3.65
4	600535	天士力	6,123,835.07	3.57
5	002572	索菲亚	4,200,000.00	2.45
6	000895	双汇发展	3,958,840.00	2.31
7	600563	法拉电子	3,785,628.00	2.21
8	603366	日出东方	3,726,432.00	2.17
9	002250	联化科技	3,548,120.16	2.07
10	000538	云南白药	3,503,945.07	2.04
11	002202	金风科技	3,460,767.76	2.02
12	600422	昆药集团	3,381,600.00	1.97
13	002521	齐峰新材	3,343,847.18	1.95
14	000001	平安银行	3,338,785.43	1.95
15	601318	中国平安	3,322,560.00	1.94
16	601166	兴业银行	3,321,000.00	1.94
17	600104	上汽集团	3,311,550.00	1.93
18	002304	洋河股份	3,302,745.00	1.93
19	600000	浦发银行	3,280,800.00	1.91
20	000762	西藏矿业	3,251,040.00	1.90

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000848	承德露露	7,323,900.00	4.27
2	600535	天士力	6,810,845.73	3.97
3	000596	古井贡酒	6,316,260.00	3.68
4	600276	恒瑞医药	6,162,920.00	3.59
5	600422	昆药集团	4,606,484.00	2.69
6	002521	齐峰新材	4,401,254.00	2.57

7	002250	联化科技	4,320,000.00	2.52
8	603366	日出东方	4,200,000.00	2.45
9	600778	友好集团	4,121,600.00	2.40
10	000762	西藏矿业	4,056,000.00	2.36
11	002304	洋河股份	4,001,412.00	2.33
12	000538	云南白药	3,952,207.00	2.30
13	000069	华侨城 A	3,852,590.00	2.25
14	000726	鲁 泰 A	3,805,120.00	2.22
15	000550	江铃汽车	3,637,200.00	2.12
16	002567	唐人神	3,552,000.00	2.07
17	600563	法拉电子	3,487,000.00	2.03
18	600000	浦发银行	3,302,400.00	1.93
19	002568	百润股份	3,235,410.00	1.89
20	000002	万 科 A	3,203,200.00	1.87

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	147,515,210.10
卖出股票收入（成交）总额	136,384,031.31

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	60,744,000.00	35.41
2	央行票据	—	—
3	金融债券	18,603,776.70	10.84
	其中：政策性金融债	18,603,776.70	10.84
4	企业债券	25,149,000.00	14.66
5	企业短期融资券	20,060,000.00	11.69

6	中期票据	52,553,000.00	30.63
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
8	其他	—	—
9	合计	177,109,776.70	103.24

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	150023	15 付息国债 23	500,000	50,720,000.00	29.57
2	1480042	14 泉州高新债	100,000	11,145,000.00	6.50
3	101354013	13 浙能源 MTN002	100,000	11,025,000.00	6.43
4	150210	15 国开 10	100,000	10,836,000.00	6.32
5	1382056	13 北车集 MTN1	100,000	10,487,000.00	6.11

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

本基金投资的前十名股票没有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	57,925.15
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,964,542.02
5	应收申购款	500.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,022,967.17

### 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

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
创金聚 利 A 级	1,016	121,304.72	—	—	123,245,595.19	100.00%
创金聚 利 C 级	435	85,561.49	—	—	37,219,249.95	100.00%
合计	1,451	110,589.14	—	—	160,464,845.14	100.00%

注：本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 9.2 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	创金聚利 A 级	0.00	0.000000%
	创金聚利 C 级	2,879.08	0.007700%
	合计	2,879.08	0.001800%

## 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	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	创金聚利 A 级	0
	创金聚利 C 级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	创金聚利 A 级	0
	创金聚利 C 级	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	创金聚利 A 级	创金聚利 C 级
基金合同生效日(2015 年 05 月 15 日)基金份额总额	305,115,514.93	80,431,193.25
本报告期期初基金份额总额	—	—
本报告期期间基金总申购份额	8,468,725.89	17,968,481.48
减：报告期期间基金总赎回份额	190,338,645.63	61,180,424.78
本报告期期间基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	123,245,595.19	37,219,249.95

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，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

本报告期本基金主要操作是经历了二季度城投为主，到三季度之后逐步卖出城投债，换入利率长债以及高评级中票，提升组合整体久期和评级水平。

### 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 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监管部门稽查或处罚的情况

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	283,892,586.41	100.00%	198,373.16	100.00%	

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；

(2) 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；

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(4) 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；

(5) 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	422,427,853.27	100.00%	3,498,200,000.00	100.00%	—	—