

创金合信聚利债券型证券投资基金2016年半年度报告摘要

2016年06月30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08月27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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月19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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年01月01日起至06月30日止。

§ 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	83,764,199.42	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	创金聚利A级	创金聚利C级
下属两级基金的交易代码	001199	001200
报告期末下属两级基金的份 额总额	64,282,038.88	19,482,160.54

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	<p>本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。</p> <p>回购套利策略是本基金重要的操作策略之一，把信用产品投资和回购交易结合起来，管理人根据信用产品的特征，在信用风险和流动性风险可控的前提下，或者通过回购融资来博取超额收益，或者通过回购的不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。</p>

	<p>当本基金管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时，本基金可以直接参与股票市场投资，努力获取超额收益。在股市场投资过程中，本基金主要采取自下而上的投资策略，利用数量化投资技术与基本面研究相结合的研究方法，对以下三类上市公司进行投资：</p> <p>（1）现金流充沛、行业竞争优势明显、具有良好的现金分红记录或现金分红潜力的优质上市公司；</p> <p>（2）投资价值明显被市场低估的上市公司；</p> <p>（3）未来盈利水平具有明显增长潜力且估值合理的上市公司。</p>
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

登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

	创金聚利A级	创金聚利C级
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年01月01日-2016年06月30日）	
本期已实现收益	2,495,769.51	665,571.27
本期利润	-1,020,615.04	-383,458.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0113	-0.0140
本期基金份额净值增长率	-0.19%	-0.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0683	0.0637
期末基金资产净值	68,674,988.06	20,724,100.61
期末基金份额净值	1.0680	1.0640

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6月30日。

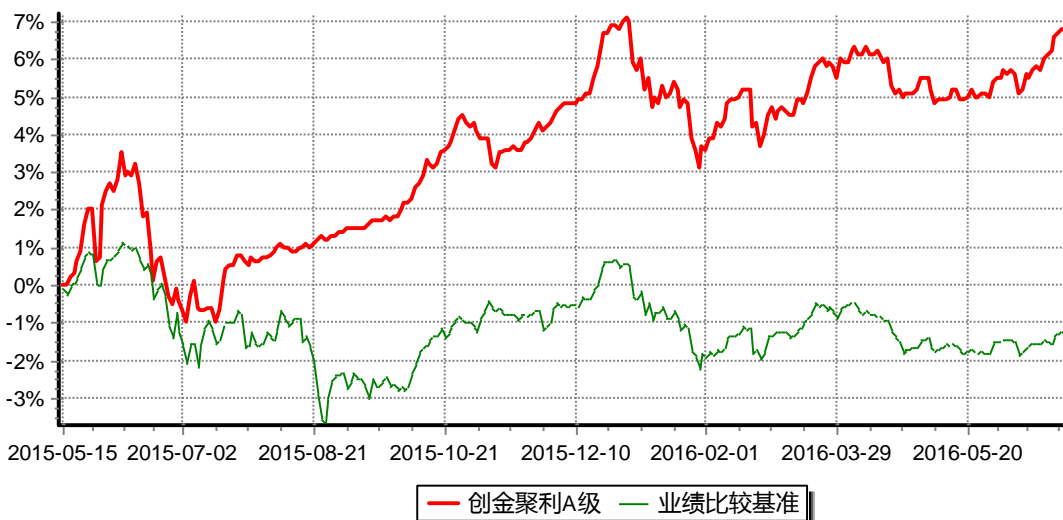
3.2 基金净值表现

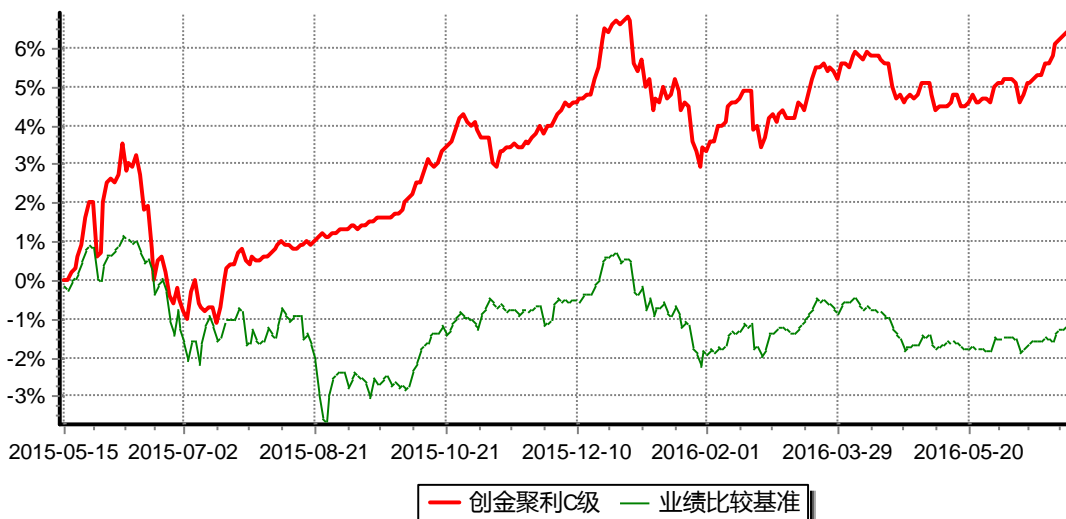
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	1.33%	0.19%	0.28%	0.12%	1.05%	0.07%
过去三个月	0.85%	0.19%	-0.64%	0.12%	1.49%	0.07%
过去六个月	-0.19%	0.29%	-1.67%	0.20%	1.48%	0.09%
过去一年	6.91%	0.25%	-0.47%	0.24%	7.38%	0.01%
自基金合同生效日起至今（2015年05月15日-2016年06月30日）	6.80%	0.30%	-1.20%	0.25%	8.00%	0.05%

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
过去一个月	1.33%	0.17%	0.28%	0.12%	1.05%	0.05%
过去三个月	0.76%	0.18%	-0.64%	0.12%	1.40%	0.06%
过去六个月	-0.28%	0.28%	-1.67%	0.20%	1.39%	0.08%
过去一年	6.61%	0.24%	-0.47%	0.24%	7.08%	0.00%
自基金合同生效日起 至今(2015年05月15 日-2016年06月30日)	6.40%	0.29%	-1.20%	0.25%	7.60%	0.04%

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





§ 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6只公募基金。截至2016年6月30日，本公司共管理13只公募基金，其中混合型产品4只、指数型产品2只、债券型产品5只、股票型产品1只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约68亿元。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王一兵	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，作为公司入市代表任海南中商

					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	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。2014年8月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。
张荣	基金经理	2015年06月11日	—	6	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,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。

4.3.2 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年上半年，债券市场先熊后牛的格局。一季度经济数据短期企稳，央行难以进一步宽松，债市整体震荡上行；步入二季度，4月份，央企中铁物资的债券违约引爆市场的信用担忧，基金净值明显下滑，保险、银行等机构大规模赎回基金、券商资管，形成流动性冲击。再叠加一季度经济短期数据向好，债券市场整体受到抛售及基本面的冲

击，短债、长债，高低评级的收益率均明显上行。不过，随着流动性冲击的过去，以及一二线热点城市调控导致房地产销售整体高位回落，去产能压力下，房地产和制造业投资增速下滑加快，经济重新转为偏弱的局面。在市场配置资金依旧充足的情形下，安全资产依旧是市场的选择。另外，央行维稳货币市场的意愿未变，年中MPA考核对银行间流动性的冲击较小。因此，5月份之后，债券市场又重新走强。本报告期本基金主要操作是适时调整组合久期，主要配置高评级信用债和利率债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年上半年创金合信聚利A级净值增长率-0.19%，聚利C级净值增长率-0.28%，同期业绩比较基准增长率为-1.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体而言，下半年经济下行压力维持。出口方面，退欧导致外需环境新添变数，但尚不构成实质影响。投资方面，短期而言，一二线受调控影响销售下降还将持续，但速度将有所放缓，考虑去年7/8月份的高基数，预计整体房地产市场销售在四季度后才可能有所企稳。年内房地产投资还可能继续有所下滑。考虑到国企去产能也开始加快推进及对民企融资约束的加剧，制造业投资整体的向下压力仍然较大。鉴于当前政府对结构改革的强调更多，对短期经济波动的容忍力度在加大。因此，预计基建投资未来还将保持在20%左右的高增速，但不会有更大力度的刺激。货币政策方面，在目前央行的框架下，五月以来，防风险促改革的重要性已经排在稳增长之前。稳增长次序的排后，货币政策进一步宽松的必要性降低，而通胀压力较低且稳定，也使央行转向紧缩的可能性也很小。退欧带来人民币汇率短期贬值压力和波动加大，不过预计央行将会稳定汇率。汇率不构成对货币政策的明显制约。预计央行货币政策很可能维持总体稳定的局面不变。

2016年本基金将继续以高评级债券及利率债为主要投资品种，择机进行波段操作，提升收益，同时规避中低评级产业债的信用风险。

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。本报告期内，创金合信聚利债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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2016年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2016年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
资 产：		
银行存款	9,080,296.62	28,052,291.07
结算备付金	1,892,415.52	237,678.66
存出保证金	15,989.33	57,925.15
交易性金融资产	97,808,471.30	193,936,600.70
其中：股票投资	11,365,811.60	16,826,824.00
基金投资	—	—
债券投资	86,442,659.70	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	895,113.05	2,964,542.02
应收股利	—	—
应收申购款	200.00	500.00
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	109,692,485.82	225,249,537.60
负债和所有者权益	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：		
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	14,500,000.00	48,099,327.85

应付证券清算款	4,503,251.96	4,836,227.92
应付赎回款	1,116,025.38	291,485.77
应付管理人报酬	53,278.77	103,541.64
应付托管费	15,222.52	29,583.33
应付销售服务费	7,291.04	12,980.63
应付交易费用	9,710.10	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	88,617.38	103,115.40
负债合计	20,293,397.15	53,697,509.37
所有者权益：		
实收基金	83,764,199.42	160,464,845.14
未分配利润	5,634,889.25	11,087,183.09
所有者权益合计	89,399,088.67	171,552,028.23
负债和所有者权益总计	109,692,485.82	225,249,537.60

注：1.报告截止日2016年6月30日，基金份额总额83,764,199.42份，其中下属A类基金份额64,282,038.88份，C类基金份额19,482,160.54份。下属A类基金份额净值1.068元，C类基金份额净值1.064元。

2. 本财务报表的上年度可比期间为2015年05月15日(基金合同生效日)至2015年06月30日。

6.2 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：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016 年06月30日	上年度可比期间2015年01月 01日-2015年06月30日
一、收入	-457,010.34	2,228,196.92
1.利息收入	2,800,066.16	1,397,157.09
其中：存款利息收入	41,750.90	82,980.66

债券利息收入	2,758,315.26	1,074,376.86
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	239,799.57
其他利息收入	—	—
2.投资收益	1,304,119.44	5,918,228.38
其中：股票投资收益	-231,046.51	10,919,887.24
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,443,539.75	-5,324,766.68
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	91,626.20	323,107.82
3.公允价值变动收益	-4,565,414.78	-5,150,579.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,218.84	63,390.85
减：二、费用	947,063.66	763,872.18
1. 管理人报酬	434,752.66	312,961.92
2. 托管费	124,215.06	89,417.70
3. 销售服务费	57,462.52	36,006.00
4. 交易费用	27,143.93	224,568.71
5. 利息支出	183,802.19	77,939.02
其中：卖出回购金融资产支出	183,802.19	77,939.02
6. 其他费用	119,687.30	22,978.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,404,074.00	1,464,324.74
减：所得税费用	—	—

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,404,074.00	1,464,324.74
-------------------	---------------	--------------

6.3 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：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日-2016年06月30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)	160,464,845.14	11,087,183.09	171,552,028.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-1,404,074.00	-1,404,074.00
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)	-76,700,645.72	-4,048,219.84	-80,748,865.56
其中：1.基金申购款	897,790.28	47,860.50	945,650.78
2.基金赎回款	-77,598,436.00	-4,096,080.34	-81,694,516.34
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)	83,764,199.42	5,634,889.25	89,399,088.67
项 目	上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30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)	—	1,464,324.74	1,464,324.74
三、本期基金份额交易产生的	-101,124,859.0	-1,799,119.08	-102,923,978.11

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	3		
其中：1.基金申购款	2,786,004.32	64,816.79	2,850,821.11
2.基金赎回款	-103,910,863.35	-1,863,935.87	-105,774,799.22
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)	284,421,849.15	-334,794.34	284,087,054.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至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

6.4 报表附注

6.4.1 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,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(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×90%+沪深300指数收益率×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8月26日批准报出。

6.4.2 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6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年1月1日至2016年6月30日止期间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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 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。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日	
	成交金额	占当期股票成	成交金额	占当期股票成

		交总额的比例		交总额的比例
第一创业证券	9,905,905.00	76.88%		—

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
第一创业证券	7,124.53	72.09%	2,247.47	44.90%

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，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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。

6.4.8.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30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	141,782,416.89	90.24%	—	—

6.4.8.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日	上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日

	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例
第一创业证券	1,065,700,000.00	82.22%	—	—

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016 年06月30日	上年度可比期间 2015年01月01日-2015 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	434,752.66	312,961.92
其中：支付销售机构的客户维护费	290,026.71	216,246.38

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016 年06月30日	上年度可比期间 2015年01月01日-2015 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	124,215.06	89,417.70

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。

6.4.8.2.3 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01月01日-2016年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金聚利A级	创金聚利C级	合计

第一创业证券	—	135.73	135.73
合计	—	135.73	135.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	创金聚利A级	创金聚利C级	合计
第一创业证券		3.52	3.52
合计	—	3.52	3.52

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年01月01日-2016年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
工商银行	—	10,401,006.61		—	—	—

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日	
	创金聚利A级	创金聚利C级	创金聚利A级	创金聚利C级
期初持有的基金份额	—	—	—	—
期间申购/买入总份额	—	—	—	—

期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	—	—	—
占基金总份额比例	—	—	—	—

注：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。

6.4.8.4.2 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

关联方名称	本期末 2016年06月30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

注：本报告期内无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 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01月01日-2016年06月30日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	9,080,296.62	34,939.01	35,416,455.40	74,780.51

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2016年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本期末未持有因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
000524	岭南控股	2016-04-05	重大资产重组	13.08			15,000	279,000.00	196,200.00
300298	三诺生物	2016-03-21	重大资产重组	20.96	2016-08-04	23.06	7,020	183,600.00	147,139.20
002065	东华软件	2015-12-22	重大事项	18.75	2016-07-04	22.59	1,000	22,250.00	18,750.00

注：本基金截至2016年6月30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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于本期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30日止，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14,500,000.00元，于2016年7月1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。

6.4.10 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2016年6月30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17,432,322.40元，属于第二层次的余额为80,376,148.90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2016年6月30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。

§7 投资组合报告

7.1 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	11,365,811.60	10.36
	其中：股票	11,365,811.60	10.36
2	固定收益投资	86,442,659.70	78.80
	其中：债券	86,442,659.70	78.80
	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	10,972,712.14	10.00
6	其他资产	911,302.38	0.83
7	合计	109,692,485.82	100.00

7.2 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	357,420.00	0.40
B	采矿业	—	—
C	制造业	8,917,677.60	9.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	791,842.00	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	563,630.00	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	272,302.00	0.30
J	金融业	—	—
K	房地产业	213,840.00	0.24
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	249,100.00	0.28
S	综合	—	—
	合计	11,365,811.60	12.71

7.3 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

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	000049	德赛电池	10,900	457,146.00	0.51
2	002223	鱼跃医疗	14,000	444,080.00	0.50
3	000919	金陵药业	33,000	431,970.00	0.48
4	300147	香雪制药	29,000	427,170.00	0.48
5	600196	复星医药	22,300	424,146.00	0.47
6	600055	华润万东	23,520	413,011.20	0.46
7	002004	华邦健康	44,000	401,720.00	0.45
8	600587	新华医疗	17,000	392,530.00	0.44
9	002029	七匹狼	38,000	385,700.00	0.43
10	600398	海澜之家	32,000	361,600.00	0.40

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.cjhxfund.com网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	300199	翰宇药业	288,000.00	0.17
2	000919	金陵药业	286,000.00	0.17
3	300147	香雪制药	285,000.00	0.17
4	600177	雅戈尔	283,500.00	0.17
5	600199	金种子酒	282,200.00	0.16
6	002004	华邦健康	282,100.00	0.16
7	600196	复星医药	282,000.00	0.16
8	600559	老白干酒	282,000.00	0.16
9	600055	华润万东	281,440.00	0.16
10	600587	新华医疗	280,800.00	0.16
11	000428	华天酒店	280,000.00	0.16
12	002055	得润电子	279,395.00	0.16

13	002223	鱼跃医疗	279,000.00	0.16
14	601799	星宇股份	279,000.00	0.16
15	000049	德赛电池	278,380.00	0.16
16	300347	泰格医药	277,200.00	0.16
17	002094	青岛金王	276,000.00	0.16
18	603001	奥康国际	270,000.00	0.16
19	000661	长春高新	31,519.20	0.02

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。

7.4.2 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

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600199	金种子酒	501,100.00	0.29
2	300159	新研股份	323,000.00	0.19
3	300199	翰宇药业	316,800.00	0.18
4	600177	雅戈尔	315,000.00	0.18
5	600521	华海药业	313,200.00	0.18
6	300347	泰格医药	311,300.00	0.18
7	600559	老白干酒	310,200.00	0.18
8	000915	山大华特	308,550.00	0.18
9	002436	兴森科技	308,000.00	0.18
10	002055	得润电子	307,800.00	0.18
11	601799	星宇股份	305,970.00	0.18
12	000568	泸州老窖	297,000.00	0.17
13	002094	青岛金王	295,200.00	0.17
14	600807	天业股份	290,700.00	0.17
15	600893	中航动力	229,400.00	0.13
16	601566	九牧王	229,000.00	0.13
17	600435	北方导航	218,085.00	0.13
18	600372	中航电子	216,150.00	0.13

19	600298	安琪酵母	210,800.00	0.12
20	600685	中船防务	205,920.00	0.12

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。

7.4.3 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	5,083,534.20
卖出股票收入（成交）总额	7,832,845.00

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。

7.5 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	37,026,121.20	41.42
2	央行票据	—	—
3	金融债券	20,452,000.00	22.88
	其中：政策性金融债	20,452,000.00	22.88
4	企业债券	22,535,938.50	25.21
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	6,428,600.00	7.19
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	86,442,659.70	96.69

7.6 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	150207	15国开07	200,000	20,452,000.00	22.88
2	160010	16付息国债	200,000	20,102,000.00	22.49

		10			
3	010303	03国债(3)	115,160	11,927,121.20	13.34
4	122304	13兴业03	63,830	6,556,617.60	7.33
5	112273	15金街01	62,000	6,335,780.00	7.09

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券中包括13兴业03（证券代码122304），根据兴业证券股份有限公司于2016年6月13日发布的公告，于6月12日收到中国证券监督管理委员会调查通知书。在上述公告公布后，本基金管理人对上述上市公司进行进一步了解和视为上述调查不会对13兴业03的投资价值构成实质性的负面影响，因此本基金管理人对上述债券的投资判断未发生改变。

7.12.2 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。

7.12.3 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	15,989.33
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	895,113.05
5	应收申购款	200.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	911,302.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	1,081,100.00	1.21
2	123001	蓝标转债	1,077,000.00	1.20

7.12.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	659	97,544.82	—	—	64,282,038.88	100.00%
创金聚	262	74,359.39	—	—	19,482,160.	100.00

利C级					54	%
合计	896	93,486.83	—	—	83,764,199.42	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	创金聚利A级	—	—
	创金聚利C级	—	—
	合计	—	—

8.3 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	0~10
	创金聚利C级	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金聚利A级	0~10
	创金聚利C级	0~10
	合计	0~10

§ 9 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	123,245,595.19	37,219,249.95
本报告期基金总申购份额	333,886.96	563,903.32
减：本报告期基金总赎回份额	59,297,443.27	18,300,992.73
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	64,282,038.88	19,482,160.54

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无重大改变。

10.5 基金改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业证券	2	9,905,905	76.88%	7,124.53	72.09%	
东兴证券	2	2,978,955	23.12%	2,757.63	27.91%	
国信证券	2	—	—	—	—	
银河证券	2	—	—	—	—	
中银国际证	2	—	—	—	—	

券						
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东兴证券2个交易单元、中银国际证券2个交易单元。

10.7.2 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比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
第一创业证券	141,403,415.3	90.28%	1,065,700,000	82.22%	—	—
东兴证券	15,219,792	9.72%	230,500,000	17.78%	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
中银国际证券	—	—	—	—	—	—
中信建投证券	—	—	—	—	—	—

创金合信基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日