

创金合信聚利债券型证券投资基金2016年年度报告摘要

2016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：2017年03月27日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月22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。

本报告期自2016年01月01日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	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	100,737,449.93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	84,422,593.58份	16,314,856.35份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
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	郭明
	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	创金聚利A级	
	2016年	2015年05月15日-2015年12月31日
本期已实现收益	-3,351,300.27	10,138,275.50
本期利润	-8,947,742.06	11,960,111.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0860	0.0623
本期基金份额净值增长率	1.31%	7.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0496	0.0590
期末基金资产净值	91,520,118.77	131,836,849.30
期末基金份额净值	1.084	1.070

3.1.3 期间数据和指标	创金聚利C级	
	2016年	2015年05月15日-2015年12月31日
本期已实现收益	64,340.75	2,665,847.49
本期利润	-163,876.48	3,302,058.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0073	0.0643
本期基金份额净值增长率	0.66%	6.70%
3.1.4 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0403	0.0564
期末基金资产净值	17,529,516.91	39,715,178.93
期末基金份额净值	1.074	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。

3.2 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

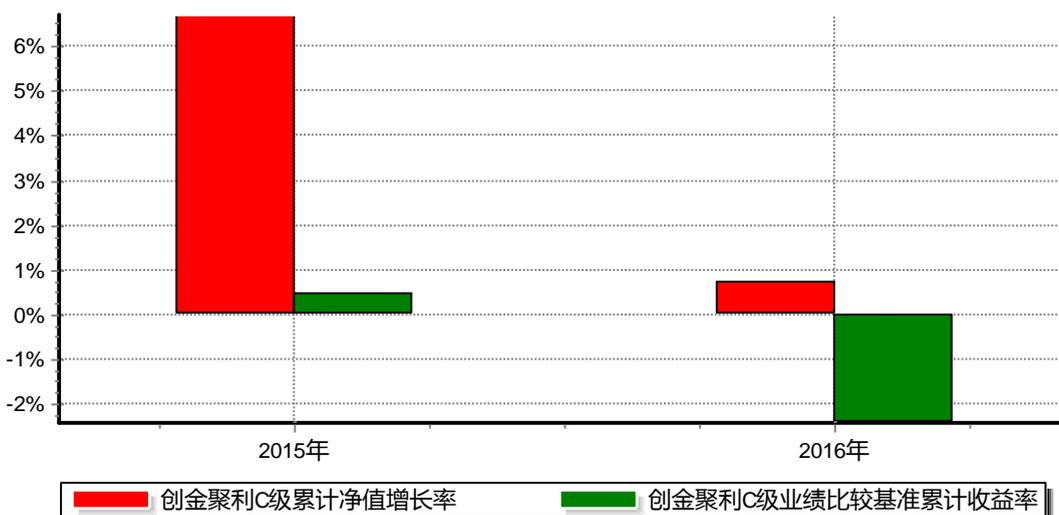
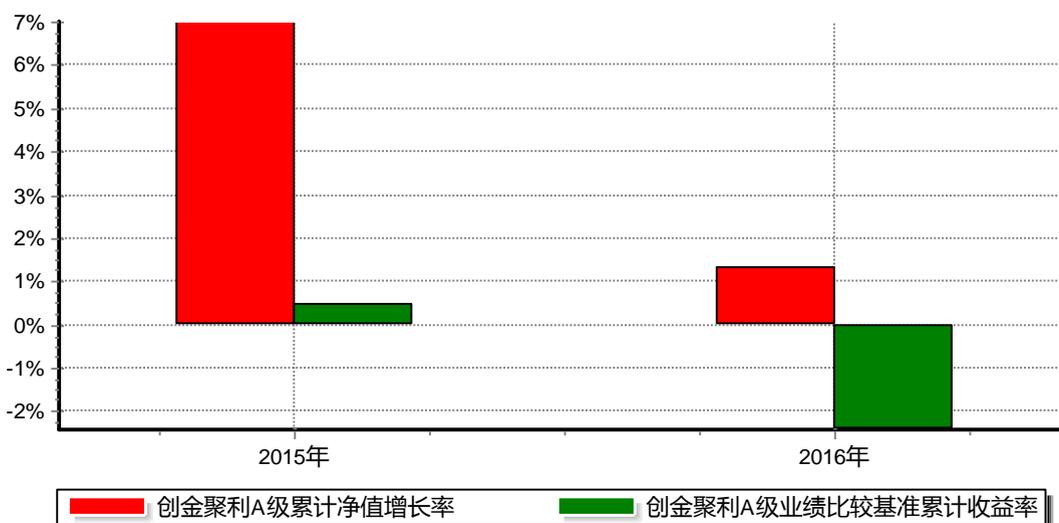
阶段 (创金聚利A级)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.28%	0.25%	-1.90%	0.17%	1.62%	0.08%
过去六个月	1.50%	0.23%	-0.77%	0.14%	2.27%	0.09%
过去一年	1.31%	0.26%	-2.43%	0.17%	3.74%	0.09%
自基金合同生效日起至今(2015年05月15日-2016年12月31日)	8.40%	0.28%	-1.97%	0.22%	10.37%	0.06%

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	-0.74%	0.23%	-1.90%	0.17%	1.16%	0.06%
过去六个月	0.94%	0.22%	-0.77%	0.14%	1.71%	0.08%
过去一年	0.66%	0.25%	-2.43%	0.17%	3.09%	0.08%
自基金合同生效日起至今(2015年05月15日-2016年12月31日)	7.40%	0.27%	-1.97%	0.22%	9.37%	0.05%

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



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

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17只公募基金。截至2016年12月31日，本公司共管理24只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品3只、债券型产品8只、股票型产品3只、货币型产品1只；管理的公募基金规模约142.74亿元。

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	基金经理、固定收益部总监	2015年05月15日	—	12	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，作为公司上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	—	7	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，权益投资基金经理。投资中注重宏观研究，自上而下，把握行业趋势；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，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、反向交易进行了专项分析，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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年成为2014年以来债牛的末期，并在年底开始扭转走熊。主要变化因素在于：第一，2016年经济整体走平，步入L型的底部阶段，而同时大宗商品价格暴涨、以房价为首的资产价格暴涨；第二，5月9日《人民日报》刊登了《开局首季问大势》的权威人士讲话，正式确认了宏观政策从稳增长向防风险、抑泡沫重心转换；第三，在经济走稳、通胀预期抬升的基础上，为防风险、抑泡沫，货币政策最终在下半年开始通过公开市场释放长期限资金，抬升利率水平，并实施将理财纳入MPA考核等宏观审慎措施。在上述因素变化下，同时叠加了流动性危机，年底债市收益率大幅上行，幅度普遍在100-150bp。在债券市场极度紧张时期，央行及时释放流动性，守住系统性风险不发生的底线。2016年本基金采取稳健投资策略，在防范风险的同时为投资者赚取更好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年本基金A类净值增长率为1.31%，C类净值增长率为0.66%，同期业绩比较基准增长率为-2.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前来看，货币政策可能进一步收紧，但大幅收紧的可能性需要密切关注经济。主要原因在于：第一，防风险、抑泡沫仍是当前货币政策的重点，也因此存在进一

步收紧的可能；第二，从目前来看，房地产价格的泡沫程度得到初步控制，一二线热点城市房价环比涨幅持续回落，而债市、汇市、股市等领域的泡沫程度不显著，同时表外理财扩张也受到宏观审慎评估体系（简称MPA）约束，因此央行就风险泡沫大幅收紧的必要性还不是很大；第三，年初信贷放量的持续性将是需要密切关注的。如果是实体经济需求强劲所致，那么通胀压力将会较大，货币政策的收紧力度有可能会超出预期。在货币政策收缩的过程中，债券市场难以出现趋势性机会，而在政策步入紧缩后期和经济下行压力重现之前，长债的交易机会也不会明显。经过去年底及今年初的大幅调整，债市总体收益率水平已处于较高的位置，尤其是高评级的配置价值仍是可行的，再度急剧上升的风险不显著。

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

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

本基金本报告期内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合规守信、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）审计了 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 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：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	12,713,231.34	28,052,291.07
结算备付金	2,277,415.67	237,678.66
存出保证金	35,760.70	57,925.15
交易性金融资产	122,804,763.68	193,936,600.70
其中：股票投资	21,603,696.00	16,826,824.00
基金投资	—	—

债券投资	101,201,067.68	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	2,974,553.80	—
应收利息	1,565,075.95	2,964,542.02
应收股利	—	—
应收申购款	2,186.02	500.00
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	142,372,987.16	225,249,537.60
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	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	31,000,000.00	48,099,327.85
应付证券清算款	1,153,078.24	4,836,227.92
应付赎回款	653,695.23	291,485.77
应付管理人报酬	185,446.96	103,541.64
应付托管费	52,984.84	29,583.33
应付销售服务费	6,063.23	12,980.63
应付交易费用	79,318.95	212,130.78
应交税费	—	—
应付利息	18,763.48	9,116.05
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	174,000.55	103,115.40
负债合计	33,323,351.48	53,697,509.37

所有者权益：		
实收基金	100,737,449.93	160,464,845.14
未分配利润	8,312,185.75	11,087,183.09
所有者权益合计	109,049,635.68	171,552,028.23
负债和所有者权益总计	142,372,987.16	225,249,537.60

注：1.报告截止日2016年12月31日，基金份额总额100,737,449.93份，其中下属A类基金份额84,422,593.58份，C类基金份额16,314,856.35份。下属A类基金份额净值1.084元，C类基金份额净值1.074元。

2.本基金合同生效日为2015年5月15日，上年度可比期间为2015年5月15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：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日至 2016年12月31日	上年度可比期间2015年05月15 日至2015年12月31日
一、收入	-6,894,071.78	18,180,725.43
1.利息收入	5,363,147.84	7,565,965.02
其中：存款利息收入	109,164.02	187,091.88
债券利息收入	5,223,519.81	7,137,522.88
资产支持证券利息收 入	—	—
买入返售金融资产收 入	30,464.01	241,350.26
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	-6,510,477.72	8,057,633.38
其中：股票投资收益	-3,765,310.18	5,299,429.21
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-2,844,201.54	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	99,034.00	376,777.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-5,824,659.02	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）	77,917.12	99,080.70
减：二、费用	2,217,546.76	2,918,556.11
1. 管理人报酬	940,745.43	1,088,521.63
2. 托管费	268,784.42	311,006.25
3. 销售服务费	95,785.81	131,199.31
4. 交易费用	191,915.50	391,299.79
5. 利息支出	492,453.80	861,142.23
其中：卖出回购金融资产支出	492,453.80	861,142.23
6. 其他费用	227,861.80	135,386.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-9,111,618.54	15,262,169.32
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-9,111,618.54	15,262,169.32

注：本基金合同生效日为2015年5月15日，上年度可比期间为2015年5月15日至2015年12月31日。

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：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日至2016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）	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）	—	-9,111,618.54	-9,111,618.54
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）	-59,727,395.21	6,336,621.20	-53,390,774.01
其中：1.基金申购款	321,274,574.53	31,856,537.44	353,131,111.97
2.基金赎回款	-381,001,969.74	-25,519,916.24	-406,521,885.98
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）	100,737,449.93	8,312,185.75	109,049,635.68
项 目	上年度可比期间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

注：本基金合同生效日为2015年5月15日，上年度可比期间为2015年5月15日至2015年12月31日。

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]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%。

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2016年度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12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

本基金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。

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。

(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，股票的股息、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,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

7.4.7.1 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。

7.4.7.2 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

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 2016年01月01日至2016年12月31日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
第一创业证券	9,905,905.00	6.56%	283,892,586.41	100.00%

股份有限公司				
--------	--	--	--	--

7.4.8.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均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 2016年01月01日至2016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	7,124.53	8.01%	—	—
关联方名称	上年度可比期间 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，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。

7.4.8.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年05月15日至2015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	141,782,416.89	35.01%	422,427,853.27	100.00%

7.4.8.1.5 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日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年05月15日至2015年12月31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 股份有限公司	1,065,700,000.00	35.11%	1,759,100,000.00	10.00%

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 2016年01月01日至2016年12月31日	上年度可比期间 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	940,745.43	1,088,521.63
其中：支付销售机构的客户维护费	464,791.15	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 2016年01月01日至2016年12月31日	上年度可比期间 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	268,784.42	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X 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 2016年01月01日至2016年12月31日		
	创金聚利A级	创金聚利C级	合计
工商银行	—	93,349.88	93,349.88
第一创业证券	—	135.73	135.73
合计	-	93485.61	93485.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间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
第一创业证券	—	—	37.04
工商银行	—	126,789.73	—
第一创业证券	—	37.04	—
合计	-	126826.77	126826.77

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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2016年01月01日至2016年12月31日					
	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
中国工商银行		20,580,636.34				
上年度可比期间 2015年05月15日至2015年12月31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
中国工商银行	—					

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 2016年01月01日至2016年12月31 日		上年度可比期间 2015年05月15日至2015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
中国工商银行 活期存款	12,713,231.34	87,166.55	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

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生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

无

7.4.9 期末（2016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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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(股)	期末成本总额	期末估值总额
002727	一心堂	2016-12-28	重大事项停牌	21.20	2017-01-05	21.66	21,400	565,300.00	453,680.00
300100	双林股份	2016-11-07	重大事项停牌	34.00	2017-01-25	30.60	12,000	410,400.00	408,000.00
600859	王府井	2016-09-27	重大事项停牌	16.28			14,300	279,400.00	232,804.00
000887	中鼎股份	2016-11-18	重大事项停牌	25.94	2017-02-15	23.99	7,500	185,250.00	194,550.00

注：本基金截至2016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2016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为0，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31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31,000,000.00元，于2017年1月3日和2017年1月4日先后到期。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。

7.4.10 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37,461,751.48元，属于第二层次的余额为85,343,012.20元，无属于第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次16,301,904.00元，第二层次177,634,696.70元，无第三层次)。

(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。

(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12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2015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	21,603,696.00	15.17
	其中：股票	21,603,696.00	15.17
2	固定收益投资	101,201,067.68	71.08
	其中：债券	101,201,067.68	71.08
	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	14,990,647.01	10.53
7	其他各项资产	4,577,576.47	3.22
8	合计	142,372,987.16	100.00

8.2 报告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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	12,093,364.00	11.09
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	1,518,192.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	771,820.00	0.71
J	金融业	5,864,850.00	5.38
K	房地产业	513,010.00	0.47
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	842,460.00	0.77

S	综合	—	—
	合计	21,603,696.00	19.81

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	300003	乐普医疗	86,000	1,541,980.00	1.41
2	601211	国泰君安	38,000	706,420.00	0.65
3	000732	泰禾集团	29,000	513,010.00	0.47
4	300144	宋城演艺	22,000	460,680.00	0.42
5	002727	一心堂	21,400	453,680.00	0.42
6	600587	新华医疗	17,000	426,870.00	0.39
7	000049	德赛电池	10,000	420,500.00	0.39
8	300100	双林股份	12,000	408,000.00	0.37
9	600572	康恩贝	55,800	407,898.00	0.37
10	600061	国投安信	26,000	405,860.00	0.37

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网站的年度报告正文。

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

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	601211	国泰君安	2,804,400.00	1.63
2	600177	雅戈尔	2,149,900.00	1.25
3	000049	德赛电池	2,110,426.00	1.23
4	300199	翰宇药业	2,083,900.00	1.21
5	002675	东诚药业	1,928,000.00	1.12
6	600055	万东医疗	1,883,340.00	1.10

7	002223	鱼跃医疗	1,879,800.00	1.10
8	600054	黄山旅游	1,798,500.00	1.05
9	002736	国信证券	1,775,000.00	1.03
10	601377	兴业证券	1,687,540.00	0.98
11	000686	东北证券	1,680,551.65	0.98
12	600999	招商证券	1,653,300.00	0.96
13	601555	东吴证券	1,650,000.00	0.96
14	600369	西南证券	1,644,300.00	0.96
15	600422	昆药集团	1,640,000.00	0.96
16	600958	东方证券	1,640,000.00	0.96
17	600074	保千里	1,636,950.00	0.95
18	300383	光环新网	1,625,000.00	0.95
19	300436	广生堂	1,620,000.00	0.94
20	600718	东软集团	1,619,800.00	0.94

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600177	雅戈尔	2,169,450.00	1.26
2	300199	翰宇药业	2,156,950.21	1.26
3	601211	国泰君安	2,143,200.00	1.25
4	600055	万东医疗	1,961,160.00	1.14
5	000049	德赛电池	1,840,760.00	1.07
6	600718	东软集团	1,783,600.00	1.04
7	002675	东诚药业	1,774,530.00	1.03
8	600054	黄山旅游	1,760,584.00	1.03
9	300244	迪安诊断	1,734,240.00	1.01
10	300298	三诺生物	1,547,576.00	0.90
11	002223	鱼跃医疗	1,509,300.00	0.88

12	600030	中信证券	1,483,970.00	0.87
13	600074	保千里	1,400,974.00	0.82
14	300255	常山药业	1,223,698.05	0.71
15	600422	昆药集团	1,207,800.00	0.70
16	600587	新华医疗	1,192,800.00	0.70
17	002736	国信证券	1,188,750.00	0.69
18	601377	兴业证券	1,154,400.00	0.67
19	600369	西南证券	1,148,800.00	0.67
20	600958	东方证券	1,140,625.00	0.66

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	81,346,725.58
卖出股票收入（成交）总额	69,594,005.71

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	26,749,394.10	24.53
2	央行票据	—	—
3	金融债券	29,235,000.00	26.81
	其中：政策性金融债	29,235,000.00	26.81
4	企业债券	26,924,237.90	24.69
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	18,292,435.68	16.77
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—

10	合计	101,201,067.68	92.80
----	----	----------------	-------

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	160418	16农发18	200,000	19,618,000.00	17.99
2	010107	21国债(7)	110,000	11,577,500.00	10.62
3	124999	13武续债	95,480	10,308,020.80	9.45
4	160210	16国开10	100,000	9,617,000.00	8.82
5	019539	16国债11	60,000	5,992,200.00	5.49

8.7 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。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未被监管机构立案调查、在编制日前一年内也未受到公开谴责和处罚。

8.12.2

本报告期内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。

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	35,760.70
2	应收证券清算款	2,974,553.80
3	应收股利	—
4	应收利息	1,565,075.95
5	应收申购款	2,186.02
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,577,576.47

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123001	蓝标转债	4,348,400.00	3.99
2	128012	辉丰转债	4,313,600.00	3.96
3	110032	三一转债	3,315,600.00	3.04
4	110031	航信转债	2,171,600.00	1.99
5	128011	汽模转债	1,285,300.00	1.18
6	113008	电气转债	1,144,300.00	1.05
7	128010	顺昌转债	1,118,449.08	1.03
8	110030	格力转债	594,140.40	0.54

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分	占基金资产净	流通受限情况
----	------	------	--------	--------	--------

			的公允价值	值比例 (%)	说明
1	002727	一心堂	453,680.00	0.42	重大事项停牌
2	300100	双林股份	408,000.00	0.37	重大事项停牌

§ 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	865	97,598.37	—	—	84,422,593. 58	100.00 %
创金聚 利C级	219	74,497.06	—	—	16,314,856. 35	100.00 %
合计	1,062	94,856.36	—	—	100,737,449 .93	100.00 %

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	102,378.00	0.121268%
	创金聚利C 级	0.00	0.000000%
	合计	102,378.00	0.101629%

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	创金聚利A级	0

资和研究部门负责人持有本 开放式基金	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	123,245,595.19	37,219,249.95
本报告期基金总申购份额	319,999,584.50	1,274,990.03
减：本报告期基金总赎回份额	358,822,586.11	22,179,383.63
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	84,422,593.58	16,314,856.35

§ 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

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。

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71,999.80元，该审计机构连续提供审计服务的年限为2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，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	9,905,905.00	6.56%	7,124.53	8.01%	
东兴证券	2	9,326,987.50	6.18%	8,604.81	9.68%	
中银国际证券	2	11,551,342.00	7.65%	8,306.92	9.34%	
金元证券	2	1,586,750.00	1.05%	991.35	1.11%	
招商证券	2	56,457,426.06	37.40%	40,226.60	45.23%	
华安证券	2	62,112,320.73	41.15%	23,683.63	26.63%	
银河证券	2		—	—	—	
中信建投证券	2		—	—	—	
国信证券	2		—	—	—	
中信证券	2		—	—	—	
中泰证券	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，并能能为基金提供全面的信息服。

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银国际证券，金元证券，招商证券，华安证券，中泰证券5家券商的10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	
	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	141,782,416.89	35.01%	1,065,700,000.00	35.11%		—
东兴证券	55,679,727.84	13.75%	489,300,000.00	16.12%		—
中银国际证券	27,075,282.69	6.68%	692,700,000.00	22.82%		—
金元证券	24,929,086.72	6.15%	231,000,000.00	7.61%		—
招商证券	23,694,924.89	5.85%	1,000,000.00	0.03%		—
华安证券	131,868,290.34	32.56%	556,000,000.00	18.32%		—
银河证券		—		—		—
中信建投证券		—		—		—
国信证券		—		—		—
中信证券		—		—		—
中泰证券		—		—		—

创金合信基金管理有限公司
二〇一七年三月二十七日