

# 创金合信尊誉纯债债券型证券投资基金

2017年第4季度报告

2017年11月23日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2018年01月19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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年01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，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议于2017年11月20日审议并表决通过了《关于创金合信尊享纯债债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。根据持有人大会通过的议案及有关事项说明，本基金的最后运作日为2017年11月23日，本基金从2017年11月24日起进入清算期。基金管理人按照基金合同的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并及时予以公告。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月01日起至2017年11月23日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信尊享纯债
基金主代码	002921
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年07月11日
报告期末基金份额总额	172,018.36份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求当期收入和投资总回报最大化。
投资策略	本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪，基于对利率、信用等市场的分析和预测，综合运用久期配置策略、跨市场套利、杠杆放大等策略，力争实现基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，长期来看，其预期风险

	和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年10月01日 - 2017年11月23日）
1. 本期已实现收益	5,232.31
2. 本期利润	5,212.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0293
4. 期末基金资产净值	178,800.17
5. 期末基金份额净值	1.0394

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. 本基金的最后运作日为2017年11月23日，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 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

阶段	净值增长率①	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	2.98%	0.11%	-1.26%	0.07%	4.24%	0.04%

##### 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

创金合信尊享纯债债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年07月11日-2017年11月23日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
郑振源	本基金经理	2016-07-11	-	8年	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。
蒋小玲	本基金经理	2016-07-11	-	15年	蒋小玲女士，中国国籍，2002年9月-2009年12月任职于武进农村商业银行，2010年1月-2015年8月任职于江苏江南农村

					商业银行股份有限公司，历任金融市场部同业经理、交易员、投资经理等职务。2015年8月加入创金合信基金管理有限公司，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日期；

2、证券从业年限的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关决定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。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。本基金的投资范围、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 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。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 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

四季度债券市场在三季度平稳的环境下，收益率重新明显上行。1年AAA品种最多上行70bp左右，并再度突破5%水平；10年国开债最多上行70bp左右。期限利差和信用利差均明显扩大，呈现熊陡的态势。调整的过程表现为交易盘的踩踏和配置盘的严重缺失。一方面，今年以来，严监管格局下，对银行同业及表外理财的治理，促使银行体系资产负债扩张速度明显放缓，央行流动性管控中性偏紧，投向债市的配置资金明显减少；另一方面，从10月份开始，经济数据未如市场预期明显走弱，做多的交易盘转向、止损并形成一定程度的踩踏，加剧了收益率的上行。这种调整步入12月份后，才逐渐缓和，开

始震荡行情。跨年资金整体平稳，银行体系流动性较为平稳，但受MPA考核、流动性管理新规预期及货币基金扩张放缓影响，中小银行和非银机构拆借融资成本异常紧张。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，创金合信尊享纯债净值增长率为2.98%，同期业绩比较基准收益率为-1.26%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本财务报告批准报出日，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	227,773.83	99.53
8	其他资产	1,070.92	0.47
9	合计	228,844.75	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 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明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 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明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

## 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编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本报告期内未投资股票。

## 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,010.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	60.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,070.92

## 5.11.4 报告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。

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	183,290.96
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	11,272.60
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	172,018.36

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	148,098.65
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-



报告期期末管理人持有的本基金份额	148,098.65
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	86.09

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20171001-20171223	148,098.65	0.00	0.00	148,098.65	86.09%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1、大额申购风险 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时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、大额赎回风险 (1) 若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险； (2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响； (3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作； (4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动； (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额</p>							

持有人的合法权益。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议于2017年11月20日审议并表决通过了《关于创金合信尊享纯债债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。根据持有人大会通过的议案及有关事项说明，本基金的最后运作日为2017年11月23日，本基金从2017年11月24日起进入清算期。基金管理人按照基金合同的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并及时予以公告。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《创金合信尊享纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信尊享纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信尊享纯债债券型证券投资基金2017年第4季度报告原文。

### 9.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

### 9.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司  
二〇一八年一月十九日