

创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

2019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:兴业银行股份有限公司
送出日期:2019年08月27日

§ 1 重要提示
基金管理人及基金董事、监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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年08月26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。

本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,投资者欲了解详细信息,应阅读半年度报告正文。

本报告中所载资料未经理审计。
本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§ 2 基金基本情况	
2.1 基金简称	创金合信尊泰纯债债券
基金代码	002829
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月21日
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	319,517.78份
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	在严格控制风险的前提下,追求当期收入和投资回报最大化
投资策略	本基金通过对宏观经济形势的持续跟踪,基于利率、信用等市场的分析和预测,综合运用久期调整策略、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

§ 3 基金管理人	
2.3 基金管理人	基金管理人
名称	创金合信基金管理有限公司
法定代表人	吴卫
联系电话	0755-23838006
电子邮箱	linghui@cjhx.com.cn
客户服务电话	400-980-0866
网址	0755-23832671
2.4 信息披露方式	
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.cjxfund.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18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

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	兴业银行股份有限公司
法定代表人	吴卫	吴卫
联系电话	0755-23838006	021-52929999-212062
电子邮箱	linghui@cjhx.com.cn	xywyt@china.com.cn
客户服务电话	400-980-0866	95561
网址	0755-23832671	021-62169217
2.4 信息披露方式		
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.cjxfund.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18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

3.1.1 期间数据和指标	报告期末(2019年01月01日至2019年06月30日)
本期已实现收益	-16,298.84
本期利润	-17,140.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0635
本期基金份额净值增长率	-5.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0549
期末基金资产净值	301,989.62
期末基金份额净值	0.9451

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。

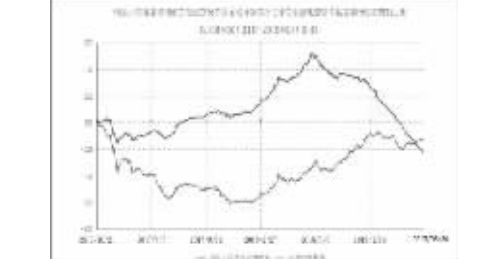
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	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	-0.88%	0.05%	0.28%	0.03%	-1.16%	0.02%
过去三个月	-2.84%	0.06%	-0.24%	0.06%	-2.60%	0.00%
过去六个月	-5.36%	0.06%	0.24%	0.06%	-5.60%	0.00%
过去一年	-6.03%	0.08%	2.82%	0.06%	-8.85%	0.02%
自基金合同生效至今	-2.26%	0.07%	-1.23%	0.08%	-1.03%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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。公司注册资本2.33亿元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司,出资比例51.0729%;深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙),出资比例21.8884%;深圳市金合中投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%;深圳市金合华投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%;深圳市金合振投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%;深圳市金合兴投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%;深圳市金合泰投资合伙企业(有限合伙),出资比例4.50645%。

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。

截至2019年6月30日,本公司共管理40只公募基金,其中混合型产品8只、指数型产品8只、债券型产品14只、股票型产品0只、货币型产品1只;管理的公募基金规模约155.17亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金助理简介

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
郑振源	本基金基金经理	2016-10-21 - 9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,担任宏观策略研究员,2012年7月加入第一创业证券资产管理部,先后担任宏观策略研究员、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。

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任命的日期;

2.证券从业年限的含义遵从行业协会《证券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

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。本基金的资产组合符合法律法规及基金合同的相关规定。

4.3 管理人对报告期内基金投资遵规守信情况的说明

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,强化事后监控及手段等手段等方式在各业务环节严格执行公平执行,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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

截至报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年债券市场呈现总体震荡格局;长端利率基本持平,短端利率总体下行,期限利差有所变陡,信用利差总体压缩。一季度利率水平总体平稳,二季度利率水平先升后降。一季度处于外部贸易对抗超预期缓和,但内部经济仍偏弱和政策宽松的环境,债市缺乏走出趋势的因素;步入二季度,一方面,一季度企业集中开工和财政刺激的加快推进,信贷投放较多,经济表现短期不弱,政策短期出现微调。4月份资金面整体出现宽松,收益率从前期低位向上反弹,不过幅度总体不显著;另一方面,步入5月份,伴随华为事件显示中美贸易摩擦有所加剧,经济短期重新走弱,货币政策重新进行了微调。6月包商银行被接管事件,短期直接导致了银行间融资市场收紧,非银机构尤其受到歧视,质押要求明显提升。央行等监管机构及时出手释放流动性,流动性危机状态得以解除。不过,非银机构及中等评级债券的质押融资能力并未得到根本修复。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信尊泰纯债债券基金份额净值为0.9451元,本报告期内,基金份额净值增长率为-5.36%,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
当前看,债市基本面无大改震荡格局。一方面,经济偏弱,政策宽松,同时利率水平总体已较低,因此债市不存在趋势性的机会和风险,行情将偏震荡。宽货币背景下信用的继续转化,将整体改善信用基本面。对于民企而言,当前政策对真实经营的优质民企融资支持较大,但市场偏见尚未显著改观,投资价值突出,弱资质民企仍需谨慎。对于城投而言,融资环境在继续改善,“妥善化解地方债务存量”的总体政策方针,以及多地已着手推进金融机构的融资支持,多方面显示公募城投债的信用在进一步提升,尤其是公益类城投债,而产业类城投则需谨慎;城投投资可适当下沉。考虑到当前中低等级主体仍在爆发违约事件,叠加包商事件总体加剧该类资产的质押融资难度,因此中低评级利差水平短期内将难以有效压缩。

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、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金持仓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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据,由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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

截至本财务报告批准报出日,本基金已连续60个工作日基金份额持有人不满二百人且资产净值低于五千万,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 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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对基金管理人基于基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为;基金管理人报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等相关内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务数据、投资组合报告等相关内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述等重大遗漏。

§ 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:创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2019年06月30日

资产	本报告期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
流动资产:		
银行存款	59,997.91	119,282.21
结算备付金	-	-
存出保证金	43.78	9,896.23
交易性金融资产	250,150.00	301,320.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	250,150.00	301,320.00
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	6,314.67	8,452.40
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	316,506.36	438,849.94
负债和所有者权益		
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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	74.82	81.56
应付托管费	24.93	27.28
应付销售服务费	-	-
应付交易费	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	14,416.99	117,376.64
负债合计	14,516.74	117,484.87
所有者权益:		
实收资本	319,517.78	321,806.56
未分配利润	-17,528.16	-449.48
所有者权益合计	301,989.62	321,356.07
负债和所有者权益总计	316,506.36	438,849.94

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.9451元,基金份额总额319,517.78份。

6.2 利润表

会计主体:创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	3,194.23	46,986,794.21
1.利息收入	5,282.93	25,004,209.71
其中:存款利息收入	652.47	51,882.28
债券利息收入	4,630.46	20,493,263.10
资产支持证券利息收入	-	3,822,446.13
买入返售金融资产收入	-	1,236,612.20
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-1,875.20	1,330,707.96
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,875.20	1,325,203.56
资产支持证券投资损益	-	5,414.39
期货投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-21,350	18,929,880.96
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	-	1,995.69
减:二、费用	20,334.57	3,002,805.65
1.管理人报酬	463.05	1,971,258.33
2.托管费	154.58	697,098.47
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	4.35	3,886.16
5.利息支出	-	224,018.17
6.其他费用	-	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-17,140.34	42,983,988.65
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-17,140.34	42,983,988.65

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	321,806.56	321,356.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-17,140.34	-17,140.34
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)	-2,287.77	-2,226.11
其中:1.基金申购款	-	-
2.基金赎回款	-2,287.77	-2,226.11
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)	319,517.78	301,989.62
项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,312,513.36	1,387,028.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-42,983,988.65	-42,983,988.65
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)	-566.10	-11.43
其中:1.基金申购款	1,002.89	9.36
2.基金赎回款	-1,568.99	-20.79
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)	-	-36,750.37
五、期末所有者权益(基金净值)	1,312,512.79	7,500,638.56
六、期末所有者权益(基金净值)	1,312,512.79	7,500,638.56

报告附注为财务报表的组成部分。
本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

苏成毅 黄晓刚 安万国

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

创金合信尊泰纯债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[2016]1859号《关于准予创金合信尊泰纯债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(以下简称“基金管理人”)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200,106,533.27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[2016]第1330号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金合同》于2016年10月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,124,533.66份基金份额,其中认购资金利息折合18,000.39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,基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券及超级短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、国债期货等,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)。本基金的投资业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率。

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》、《创金合信尊泰纯债债券型证券投资基金基金合同》和《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相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或基金资产净值低于5,000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式,与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于2019年6月30日,本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方式,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019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2019年6月30日的财务状况以及2019上半年度的经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

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[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]63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》、财税[2016]140号《关于明确金融保险地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]6号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金运用基金买卖股票、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免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货币期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或以2017年最后一个交易日的基金份额净值,非货币期货按结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从事证券市场中取得收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股票的股息、红利、债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。