

中金纯债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

2015年第1号）

基金管理人：中金基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
二〇一五年六月

重要提示

中金纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请于2014年8月19日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[2014]869号《关于准予中金纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册，并于2014年11月4日经中国证监会证券投资基金机构监管部函[2014]1680号《关于中金纯债债券型证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2014年11月4日生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于：市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作及技术风险、合规性风险、本基金特有风险、其他风险等。本基金为债券型基金，其长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，但高于货币市场基金，属于中低风险和收益水平的投资品种。

投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本基金基金份额分为A、C两类，其中A类基金份额收取认/申购费，C类基金份额不收取认/申购费，但计提销售服务费；A、C两类基金份额适用不同的赎回费率。

投资有风险，投资人认/申购本基金时应认真阅读本基金招募说明书。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2015年5月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
名称：中金基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层
法定代表人：林寿康
成立时间：2014年2月10日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：证监许可〔2014〕97号
组织形式：有限责任公司
注册资本：1亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：赵晓晓
联系电话：010-63211122
公司的股权结构如下：

股东名称	持股比例
中国国际金融有限公司	100%

（二）主要人员情况
1、基金管理人董事会成员
林寿康先生，董事长，货币经济学博士。历任国际货币基金组织国际部经济学家；香港金融管理局货币管理部高级经理；德意志摩根资产管理公司新兴市场经济学家；中国信达资产管理公司国际部副主任。现任中国国际金融有限公司投资管理业务负责人、董事总经理。

刘健女士，董事，金融学硕士。历任大连北方会计师事务所会计；香港何锡麟会计师事务所审计师；北京通成推广有限公司财务部经理；北京盛胜咨询有限公司税务咨询师；中国国际金融有限公司公司稽核部负责人。现任中国国际金融有限公司资金部负责人。

阎善先生，董事，金融学博士。曾在德意志银行股份有限公司固定收益部从事量化模型工作；历任瑞士信贷第一波士顿银行固定收益部副总经理；红狼资产管理有限公合伙人；海纳国际集团投资部高级策略师；摩根士丹利固定收益部执行总经理；箭鱼资本固定收益部高级策略师；帆船集团对冲基金投资部董事总经理；中国国际金融有限公司证券投资部量化交易组主管、董事总经理。现任中金基金管理有限公司总经理。

黄晓衡先生，独立董事，经济学硕士。历任中国建设银行江苏省分行国际业务部处长；中国建设银行伦敦代表处首席代表；中国建设银行纽约代表处首席代表；中国建设银行总行国际部副总经理，资金计划部总经理，会计部总经理；中国国际金融有限公司财务总监、公司管委会成员。并于2008年退休。

张春先生，独立董事，经济学和决策科学博士。历任美国明尼苏达大学卡尔森管理学院金融终身教授；中欧国际工商学院金融和会计系讲席教授、系主任、副教授长。现任上海交通大学上海高级金融学院教授、执行院长。

陈羽女士，独立董事，经济法硕士，EMBA硕士研究生。历任云南政法干部管理学院教师；四通集团合源法律事务所咨询主任；海南律师事务所律师；嘉和律师事务所合伙人。现任嘉源律师事务所创始合伙人。

2、基金管理人监事
夏静女士，执行监事，数学系理学硕士。历任普华永道（深圳）咨询有限公司北京分公司风险管理及内部控制服务部经理；中国国际金融有限公司公司稽核部高级经理。现任中金基金管理有限公司风险管理部执行负责人。

3、基金管理人高级管理人员
林寿康先生，董事长，货币经济学博士。简历同上。
阎善先生，总经理，金融学博士。简历同上。
罗若宏先生，副总经理，投研总监，经济学硕士。简历同上。
石云峰先生，经济学硕士。简历同上。
郭彦钰先生，工商管理硕士。历任宁波镇海炼化投资经理，华泰证券项目经理，德恒证券高级经理，华策投资有限公司投资副总经理，招商基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部执行总经理。

桑永亮先生，工学博士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所首席研究员。现任中金基金管理有限公司研究部总监助理、行业研究员。
6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况
名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田 青
联系电话：(010)6759 5096
中国建设银行拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一，中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

2014年上半年，本集团实现利润总额1,695.16亿元，较上年同期增长9.23%；净利润1,309.70亿元，较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元，较上年同期增长14.20%，其中，利息净收入增长12.59%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入增长8.39%，在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%，同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%，同业领先。

截至2014年6月末，本集团资产总额163,997.90亿元，较上年末增长6.75%，其中，客户贷款和垫款总额91,906.01亿元，增长6.99%；负债总额152,527.78亿元，较上年末增长6.75%；其中，客户存款总额129,569.56亿元，增长6.00%。

截至2014年6月末，中国建设银行客户机构客户326.89万户，较上年末增加120.35万户，增长6.64%；个人客户近3亿户，较上年末增加9921万户，增长3.17%，网上银行客户1.67亿户，较上年末增长9.23%，手机银行客户数1.31亿户，增长12.65%。

截至2014年6月末，中国建设银行境内营业机构达14,707个，服务覆盖面进一步扩大，自助设备72,128台，较上年末增加34,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%，较上年末提高高1.15个百分点。

2014年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场和业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额位列全球第2，较上年上升3位；在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第12；在美国《财富》杂志世界500强排名第38位，较上年上升12位。

中国建设银行投资银行总揽资产管理业务，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、OFI托管处、养老基金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室。在上海设立投资银行资管上海备办处，共有员工240余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常态化的内控工作手段。

（二）主要人员情况
赵观伟，投资银行业务部副总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行人银行营业部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。
纪伟，投资银行业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国

建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资银行业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资银行业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷资产部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资银行业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构
1、直销机构
（1）直销柜台
名称：中金基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层
法定代表人：林寿康
电话：010-63211122
传真：010-66159121
联系人：赵晓晓
客户服务电话：400-868-1166
公司网站：www.ciccfund.com
（2）网上直销
交易系统：中金基金网上直销系统
直销系统网址：https://trade.ciccfund.com/etrade
2、其他销售机构
（1）中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com
联系人：王琳
（2）中国国际金融有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：J·丁学东
电话：010-65051066
传真：010-65058065
联系人：杨颖宇
网址：www.cicc.com.cn
（3）国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：周杨
电话：0755-82130633
传真：0755-82133952
客服电话：95536
网址：www.guosen.com.cn
（4）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼411号
办公地址：上海市浦东新区1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
电话：021-20613999
传真：021-68596919
客服电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com
（5）齐鲁证券有限公司
注册地址：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴昊
电话：0631-68889155
传真：0631-68889185
客服电话：95538
公司网站：www.qizq.com.cn
（6）平安银行股份有限公司
客服电话：95511转2
网址：bank.pingan.com
（7）北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6号
办公地址：北京市朝阳区华严北里 2号民建大厦 6层
法定代表人：闫振杰
联系人：韩晓娟
电话：010-62020888-7071
传真：010-62020355
客户服务电话：400-889-6661
网址：www.myfund.com
基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本基金，并及时公告。

（二）登记机构
名称：中金基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室
办公地址：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层
法定代表人：林寿康
电话：010-63211122
传真：010-66155573
联系人：白娜
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：北京市海润律师事务所
住所：北京市朝阳区东三环中路6号财富金融中心20层
办公地址：北京市朝阳区东三环中路5号财富金融中心20层
负责人：张继平
电话：010-85606888
传真：010-85606999
经办律师：吴冬、魏双娟
联系人：魏双娟
（四）审计基金资产的会计师事务所
名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：中国北京长安街1号东方广场东2办公楼8层
办公地址：中国北京长安街1号东方广场东2办公楼8层
执行事务合伙人：邹俊
电话：010-85085000
传真：010-85185111
签字注册会计师：程海良、李砾
联系人：曹哲铭

四、基金的名称

中金纯债债券型证券投资基金。

五、基金的类型及运作方式

（一）基金的类型
债券型证券投资基金。
（二）基金的运作方式
契约型开放式。

六、基金的投资目标

在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。

七、基金的投资方向

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国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、可转换债券、中期票、资产支持证券、短期融资券、债券回购和银行存款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）。

本基金不直接买入股票、权证等权益类资产，仅可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持持有股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产，应在其可交易之日起30个交易日內卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券类资产不低于基金资产的80%，现金或到期日在一年以内的政府债券投资于其他基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略
本基金为债券型基金，不直接从事二级市场买入股票，也不参与一级市场新股申购或增发新股。本基金的资产配置策略主要是基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本面研究，结合对各大类资产的预期收益性、波动性及流动性等因素的评估，在约定的投资比例范围内确定各大类资产的中长期基金资产配置比例并进行调整。

（二）普通债券投资策略
1、债券类属配置策略
本基金将通过研究国民经济运行状况、货币市场及资本市场资金供求关系、分析国债、金融债、公司债、企业债、短融和中期票等不同债券品种之间的相对投资性价比，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例并根据市场变化进行调整。

2、期限结构配置策略
本基金通过同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，在给定期久期以及其他组合约束条件的情形下，确定最优的期限结构。本基金期限结构的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略等。

3、利率策略
本基金通过对经济运行状况、宏观经济运行可能情景的研判，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，可以制定组合的目标久期。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，本基金将缩短组合的久期，以减小债券价格下降带来的风险。

4、信用债投资策略
本基金通过自上而下的策略，在信用类固定收益金融工具中精选个券，结合适度分散的行业配置策略，构造并持有优化的投资组合。

（1）买入并持有策略
买入并持有策略是选择信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用类资产并持有到期，获取票息收益。选择买入并持有策略时，基金选券的原则包括：

1）债券的信用风险可承担。通过对债券的信用风险和收益进行分析，选择收益率较高、信用风险可承担的债券品种。
2）债券的信用利差合理。债券信用利差有明显的周期性变化，本基金可在信用利差较高并有减小趋势的情况下，加大买入并持有策略的力度。

3）债券的期限合理。根据利率市场的波动性，在相对高利率环境下，选择期限较长的品种，在相对低利率环境下，选择期限较短的品种。

（2）行业配置策略
基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面研究，本基金将运用定性定量模型，在自下而上的个券精选策略基础上，采取适度分散的行业配置策略，从组合层面动态优化风险收益。

（3）利差轮动策略
信用债券的利差受到经济周期、行业周期等因素的影响具有周期性变化的特征，本基金将结合对经济周期和行业周期的判断，在预期利差将变大的情况下卖出此类债券，在预期利差缩小的情况下买入此类债券，以获取利差收益。

5、骑乘策略
骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，本基金将适当买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，即收益率水平处于相对高位的债券。随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

6、息差策略
息差策略是指利用回购等方式融入低成本资金，购买较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

（三）可转换债券投资策略
在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下，本基金可对转债所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的转债进行重点关注，对可转换投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资。

（四）资产支持证券投资策略
本基金将持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展，将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，制定周密的投资策略。在具体投资过程中，重点关注标的证券未来现金流变化，基础资产的类型，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，加强对未来现金流稳定性的分析。本基金将严格控制资产支持证券的总体规模，选择风险调整后收益高的品种进行投资，实现资产支持证券对组合资产的优化贡献。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数。
中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，也是中证指数公司编制并发布的首支债券类指数。样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资人提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用T模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金基金管理人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前2个工作日内至少一种指定媒介上予以公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务信息、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。

本投资组合报告所载数据截至2015年3月31日，报告期间为2015年1月1日至2015年3月31日。本报告财务数据未经审计。

11.1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	固定收益投资	425,853,001.70	88.95
	其中：债券	425,853,001.70	88.95
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	11,723,847.24	2.45
7	其他资产	41,198,498.57	8.60
8	合计	478,775,347.51	100.00

11.2报告期末按行业分类的股票投资组合
本报告期末，本基金未持有股票。

11.3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
本报告期末，本基金未持有股票。

11.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	17,027,000.00	5.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	248,040,851.70	75.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	151,799,000.00	46.09
7	可转换	8,986,150.00	2.73
8	其他	-	-
9	合计	425,853,001.70	129.31

11.5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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101455022	14祁连山MTN001	300,000	30,909,000.00	9.39
2	122939	09吉安债	290,000	29,957,000.00	9.10
3	1382161	13渝水民MTN1	300,000	29,928,000.00	9.09
4	122883	10楚债	280,000	27,994,400.00	8.50
5	112214	14东晋债	265,000	27,345,350.00	8.30

11.6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
本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

11.7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
本报告期末，本基金未持有贵金属。

11.8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
本报告期末，本基金未持有权证。

11.9报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
11.9.1本期国债期货投资政策
本报告期末，本基金未持有国债期货。

11.9.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

11.9.3本期国债期货投资评价
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

11.10投资组合报告附注
11.10.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内本基金投资的证券前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

11.10.2本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

十二、基金的费用

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	45,622.82
2	应收证券清算款	29,999,962.00
3	应收股利	-
4	应收利息	11,072,516.93
5	应收申购款	80,396.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,198,498.57

11.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	4,904,450.00	1.46

11.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本报告期末，本基金未持有股票。

11.10.6投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示：
中金纯债A

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
2014年11月4日(基金合同生效日)至2014年12月31日	1.10%	0.08%	1.39%	0.17%	-0.29%	-0.09%

2015年1月1日至2015年3月31日	0.89%	0.13%	0.94%	0.10%	-0.05%	0.03%
2015年3月1日起至2015年3月31日	2.00%	0.11%	2.35%	0.14%	-0.35%	-0.03%

中金纯债C

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
2014年11月4日(基金合同生效日)至2014年12月31日	1.00%	0.09%	1.39%	0.17%	-0.39%	-0.08%

2015年1月1日至2015年3月31日	0.79% <th></th>	
----------------------	-----------------	--