

中金纯债债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

公告,聘任基金经理的公告确定的任职日期;

2.证券投资基金的会计处理应符合《证券投资基金会计核算办法》的相关规定;

4.2 管理人应对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

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》等有关法律法规的规定和《中金纯债债券型证券投资基金合同》的约定,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定的增值,为基金份额持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合,严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,规范投资、研究和交易等各相关流程,通过系统控制限制人工干预等方式在各环节严格控制,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

报告期内,本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度宏观经济稳中趋降,呈现出年初回落季末跃升的态势。CPI在食品价格按下继续低位低涨,PPPI在环保限产等因素扰动下环比创新高,部分中游行业已开明显的修复,未来有望回升传导。政策层面,央行在年中金融工作会议要求金融工作要“服务实体经济、防控金融风险、深化金融改革”,强调金融工作要“回归本源,优化结构,强化监管,市场导向”,金融去杠杆持续金融监管协同进一步加强。三季度流动性保持平稳,“削峰填谷”操作,资金面整体平衡,在缴税、季末等时点趋紧。此外,9月发布《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》加大了非货币基金运用低流动性债券进行资产配置的难度,资金从银行到债券的传导不畅。2017年三季度,债券市场收益率水平窄幅回落,中债综合财富指数上涨0.8%,整体表现好于二季度,其中7月、8月和9月间变动幅度分别为0.32%、-0.04%和0.52%。

本基金在三季度继续维持相对合理的久期和杠杆,保持较好的流动性,精选景气度较好的行业中龙头企业发行的各类债券,持续关注信用风险。

截至本报告期末中金纯债A基金份额净值为1.126元,本报告期基金份额净值增长率为1.08%;截至本报告期末中金纯债C基金份额净值为1.111元,本报告期基金份额净值增长率为0.91%;同期业绩比较基准收益率为0.56%。

4.6 报告期内基金持有人或基金资产净值变动说明

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 投资组合, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

注:1、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

基金管理人:中金基金管理有限公司

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
报告送出日期:2017年10月26日

5.1 重要提示
基金管理人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法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年10月26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。

基金的投资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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告日期2017年7月1日起至9月30日止。

2.2 基金产品概况

Table with columns: 基金简称, 基金代码, 基金类型, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额

3.1 主要财务指标

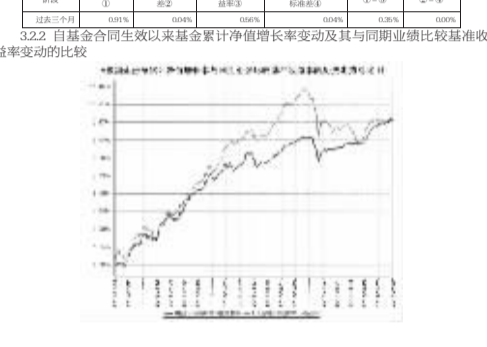
Table with columns: 主要财务指标, 报告期(2017年7月1日-2017年9月30日), 中金纯债A, 中金纯债C

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

Table with columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 中金纯债A, 中金纯债C

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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:2、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:3、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:4、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:5、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:6、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:7、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:8、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:9、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:10、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:11、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:12、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:13、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:14、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:15、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:16、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:17、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:18、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:19、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:20、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:21、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:22、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:23、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:24、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:25、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:26、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:27、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:28、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:29、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:30、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:31、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:32、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:33、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:34、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:35、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:36、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:37、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:38、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:39、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:40、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:41、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:42、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:43、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:44、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:45、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:46、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:47、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:48、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:49、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:50、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:51、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:52、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:53、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:54、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:55、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:56、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:57、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:58、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:59、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:60、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:61、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:62、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:63、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:64、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:65、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:66、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:67、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:68、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:69、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:70、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:71、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:72、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:73、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:74、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:75、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:76、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:77、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:78、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:79、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:80、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:81、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:82、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:83、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:84、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:85、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:86、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:87、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:88、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:89、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:90、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:91、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:92、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:93、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:94、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:95、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:96、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:97、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:98、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:99、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:100、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:101、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:102、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:103、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:104、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:105、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:106、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:107、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:108、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:109、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:110、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:111、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:112、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:113、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:114、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:115、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:116、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:117、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:118、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:119、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:120、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

中金现金管家货币市场基金

2017年第三季度报告

公告,聘任基金经理的公告确定的任职日期;

2.证券投资基金的会计处理应符合《证券投资基金会计核算办法》的相关规定;

4.2 管理人应对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

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》等有关法律法规的规定和《中金现金管家货币市场基金合同》的约定,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定的增值,为基金份额持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合,严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,规范投资、研究和交易等各相关流程,通过系统的限制和人工监控等方式在各环节严格控制,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

报告期内,本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度宏观经济稳中趋降,呈现出年初回落季末跃升的态势。CPI在食品价格按下继续低位低涨,PPPI在环保限产等因素扰动下环比创新高,部分中游行业已开明显的修复,未来有望回升传导。政策层面,央行在年中金融工作会议要求金融工作要“服务实体经济、防控金融风险、深化金融改革”,强调金融工作要“回归本源,优化结构,强化监管,市场导向”,金融去杠杆持续金融监管协同进一步加强。三季度流动性保持平稳,“削峰填谷”操作,资金面整体平衡,在缴税、季末等时点趋紧。此外,9月发布《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》加大了非货币基金运用低流动性债券进行资产配置的难度,资金从银行到债券的传导不畅。2017年三季度,债券市场收益率水平窄幅回落,中债综合财富指数上涨0.8%,整体表现好于二季度,其中7月、8月和9月间变动幅度分别为0.32%、-0.04%和0.52%。

本基金在三季度继续维持相对合理的久期和杠杆,保持较好的流动性,精选景气度较好的行业中龙头企业发行的各类债券,持续关注信用风险。

截至本报告期末中金现金管家A基金份额净值为1.126元,本报告期基金份额净值增长率为1.08%;截至本报告期末中金现金管家B基金份额净值为1.111元,本报告期基金份额净值增长率为0.91%;同期业绩比较基准收益率为0.56%。

4.6 报告期内基金持有人或基金资产净值变动说明

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 投资组合, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

注:1、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:2、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:3、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:4、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:5、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:6、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:7、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:8、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:9、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:10、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:11、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:12、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:13、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:14、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:15、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:16、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:17、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:18、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:19、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:20、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:21、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:22、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:23、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:24、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:25、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:26、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:27、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:28、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:29、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:30、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:31、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:32、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:33、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:34、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:35、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告

注:36、任职日期说明:任职日期为基金经理变更公告、代为履行基金经理职责的公告</