创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2018年08月29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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月28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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	创金合信尊盈纯债债券
基金主代码	002337
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年01月07日
基金管理人	创金合信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	497,967,091.43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。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋	张燕
	联系电话	0755-23838908	0755-83199084
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-868-0666	95555
传真		0755-25832571	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田中心区福华一路115号投行大厦15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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	8,553,516.58
本期利润	14,000,638.09
加权平均基金份额本期利润	0.0281
本期基金份额净值增长率	2.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0515
期末基金资产净值	523,616,436.89
期末基金份额净值	1.052

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。

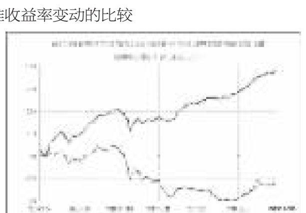
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.38%	0.05%	0.34%	0.06%	0.04%	-0.01%
过去三个月	1.15%	0.05%	1.01%	0.10%	0.14%	-0.05%
过去六个月	2.83%	0.05%	2.16%	0.08%	0.67%	-0.03%
过去一年	4.26%	0.05%	0.83%	0.06%	3.43%	-0.01%
自基金合同生效起至今	9.61%	0.07%	-2.77%	0.08%	12.38%	-0.01%

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



§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2日获得中国证监会批复,2014年7月9日正式注册设立,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11只公募基金。截至2018年6月30日,本公司共管理39只公募基金,其中混合型产品14只、指数型产品8只、债券型产品10只、股票型产品6只、货币型产品1只;管理的公募基金规模约147.33亿元。

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	本基金基金经理、固定收益部总监	2016-01-07	-	14年	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,作为公司出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	本基金基金经理	2016-01-07	-	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。

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。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债券市场整体下行,行情呈现分化。利率债、高评级债券收益率总体下行显著,10年国开债下行57bp,1-5年AAA信用债下行70bp左右,中低评级债券收益率上行。期限利差先收窄后扩大;信用利差扩大,尤其是中低评级利差扩大显著。上半年行情分化的主要原因在于:一方面,中美贸易摩擦上半年不断反复,且在二季度整体有所加剧,加大了外部环境的不确定性担忧;另一方面,在防风险环境下,银行表外融资收缩明显,同时5月初盾安债券发行人发生信用风险事件,促发了债券市场投资者的恐慌情绪,对民企的风险偏好迅速下降,债券市场融资能力衰减显著,企业流动性紧张局势加剧。外部贸易战担忧和信用收缩均形成对经济下行的压力,货币政策整体呈现边际走宽的应对状态,无风险品种及高评级信用债因此受益下行;对信用债违约风险的担忧提升,信用利差扩张显著。

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盈纯债基金份额净值为1.052元,本报告期内,基金份额净值增长率为2.83%,同期业绩比较基准收益率为2.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向前看,债券市场的总体机会大于风险,下一阶段的优势品种可能是优质信用债。基本面来看,短期经济可能会走弱,但出现失速的风险较小。外部来说,基于政治利益诉求,特朗普政府推行的逆全球化等措施会持续,中美贸易摩擦将不断,但在全球生产一体和全面对抗无益于美国经济的根本逻辑,出口出现大幅下挫的可能性并不大。内部来说,政策仍在推进结构性去杠杆,但考虑到政策的底线思维,目前已经开始针对信用收缩出台相关措施,资管新规的力度已经有所放缓。银行表外收缩并向表内扩张存在资本金、存款等阻碍仍可能不畅,对融资平台的融资约束,房地产棚改货币化安置的渐变,都会构成对未来房地产、基建投资的下行压力。不过,对于货币政策而言,利率水平维持中性偏宽,有利于降低实体融资成本,支持实体经济发展。货币市场利率水平有望维持较为宽松的状态。对信用债而言,政策预防信用过度收缩的措施,提升了优质企业获得融资的能力,信用面总体得到改善,不过弱资质企业获取流动性能力仍可能较差,发生信用风险的可能性未降低。因此,综合来看,年内债市投资选择上将以中短久期为主,而信用债投资需要维持谨慎态度,优选资质较好的发行人。本基金将继续秉承稳健的投资思路,合理配置资产品种和仓位,努力为投资者获取稳健优异的投资回报。

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

本基金本报告期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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人--招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《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,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2018年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	33,191,869.39	1,007,931.68
结算备付金	-	2,614,463.99
存出保证金	-	-
交易性金融资产	480,982,233.80	520,153,698.80
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	463,876,647.50	498,684,112.50
资产支持证券投资	17,105,586.30	21,469,586.30
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	-	58,562.37
应收利息	9,752,110.96	9,807,257.82
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	523,926,214.15	533,641,914.66
负债和所有者权益	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017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	-	23,700,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	128,772.48	129,759.30
应付托管费	42,924.16	43,253.08
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,172.47	-
应交税费	48,772.36	-
应付利息	-	-10,359.40
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	83,135.79	162,000.00
负债合计	309,777.26	24,024,652.98
所有者权益:		
实收基金	497,967,091.43	497,968,513.97
未分配利润	25,649,345.46	11,648,747.71
所有者权益合计	523,616,436.89	509,617,261.68
负债和所有者权益总计	523,926,214.15	533,641,914.66

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.052元,基金份额总额497,967,091.43份。

6.2 利润表

会计主体:创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入	15,348,468.95	9,947,570.75
1.利息收入	11,921,611.45	13,883,151.60
其中:存款利息收入	67,741.95	93,547.57
债券利息收入	11,127,020.51	12,597,723.36
资产支持证券利息收入	550,746.08	1,069,016.38
买入返售金融资产收入	176,102.91	122,864.29
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-2,020,266.51	-3,030,763.13
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,020,266.51	-3,030,763.13
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	5,447,121.51	-904,823.79
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2.50	6.07
减:二、费用	1,347,830.86	2,838,112.95
1. 管理人报酬	769,241.17	741,976.27
2. 托管费	256,413.76	247,325.45
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	325.00	900.00
5. 利息支出	193,168.83	1,748,849.38
其中:卖出回购金融资产支出	193,168.83	1,748,849.38
6. 税金及附加	33,059.04	-
7. 其他费用	95,623.06	99,061.85
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	14,000,638.09	7,109,457.80
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	14,000,638.09	7,109,457.80

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30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)	497,968,513.97	11,648,747.71	509,617,261.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,000,638.09	14,000,638.09
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)	-1,422.54	-40.34	-1,462.88
其中:1.基金申购款	7,282.52	311.40	7,593.92
2.基金赎回款	-8,705.06	-351.74	-9,056.80
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)	497,967,091.43	25,649,345.46	523,616,436.89
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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)	499,978,681.87	-2,715,320.43	497,263,361.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,109,457.80	7,109,457.80
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)	-1,985,460.25	2,008.86	-1,983,451.39
其中:1.基金申购款	9,450.19	-7.75	9,442.44
2.基金赎回款	-1,994,910.44	2,016.61	-1,992,893.83
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)	497,993,221.62	4,396,146.23	502,389,367.85

报表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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信尊盈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")《关于准予创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]3078号文)批准,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》及其配套规则和《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2016年1月7日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为200,122,552.48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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")。

本基金于2016年1月4日至2016年1月5日募集,募集期间净认购资金人民币200,113,549.63元,认购资金在募集期间产生的利息人民币9,002.85元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计200,122,552.48份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第1600141号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同》和截至报告期末最新公告的《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于固定收益类品种,包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、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、银行存款等。本基金不从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购和新股增发。因所持可转换债券与可交换债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证,在其可上市交易后不超过10个交易日的时间内卖出。本基金的业绩比较基准为: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》、《创金合信尊盈纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b)自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在2018年1月1日以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,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2015年9月8日及以后的,暂免征收个人所得税。

(e)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。

(f)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率,计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人
第一创业证券股份有限公司("第一创业证券")	基金管理人的股东
深圳市金合信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金于本报告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。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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	1,164,200,000.00	100.00%	9,296,800,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	769,241.17	741,976.27
其中:支付销售机构的客户维护费	30.16	69.05

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.30%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	256,413.76	247,325.45

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	33,191,869.39	55,912.23	2,864,904.24	26,405.80

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业存款利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事交易所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。

6.4.10 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2018年6月30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151,147.50元,第二层次的余额为480,831,086.30元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次161,612.50元,第二层次519,992,086.30元,无属于第三层次的余额)。

(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2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017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)增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,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。

此外,财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

(3)除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	480,982,233.80	91.80
	其中:债券	463,876,647.50	88.54
	资产支持证券	17,105,586.30	3.26
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	33,191,869.39	6.34
8	其他各项资产	9,752,110.96	1.86
9	合计	523,926,214.15	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.2 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

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	104,555,000.00	19.97
	其中:政策性金融债	63,707,000.00	12.17
4	企业债券	230,220,500.00	43.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	128,950,000.00	24.63
7	可转债(可交换债)	151,147.50	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	463,876,647.50	88.59

7.6 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	160213	16国开13	700,000	63,707,000.00	12.17
2	136446	16电投02	500,000	49,315,000.00	9.42
3	136258	16财通债	500,000	49,280,000.00	9.41
4	136631	16南瑞01	500,000	48,960,000.00	9.35
5	101660017	16浙商集MTN001	500,000	48,830,000.00	9.33

7.7 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	116102	三电优07	170,000	17,105,586.30	3.27

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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投资股指期货。

7.11 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投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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在编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金未投资股票。

7.12.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,752,110.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,752,110.96

7.12.4 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	128013	洪涛转债	151,147.50	0.03

7.12.5 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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
202	2,465,183.62	497,921,604.77	99.99%	45,486.66	0.01%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	22,481.41	-

8.3 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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2016年01月07日)基金份额总额	200,122,552.48
本报告期期初基金份额总额	497,968,513.97
本报告期基金总申购份额	7,282.52
减:本报告期基金总赎回份额	8,705.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	497,967,091.43

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 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改聘会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
英大证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	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要,并能为基金提供全面的信息服务。

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招商证券,广发证券,中信建投证券,英大证券,安信证券,中泰证券、长江证券7家券商的13个交易单元。

10.7.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	1,164,200,000.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20180101-20180630	497,921,604.77	0.00	0.00	497,921,604.77	99.99%
产品特有风险							

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:

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。

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,导致基金净值出现较大波动;

(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。

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持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,未出现影响投资者决策的其他重要信息。

创金合信基金管理有限公司

二〇一八年八月二十九日