

## 基金管理人:中金基金管理有限公司

1.1 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。 基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2016 年 3 月 24 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。 基金管理人东诺以诚实信用、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。 本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 1 月 31 日止。

2.1 基金基	本情况	\$2 @346 PQ71		
基金简称		中金纯债		
基金主代码		000801		
基金运作方式		契约型开放式		
基金合同生效日		2014年11月4日		
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		
报告期末基金份额总额		147,352,262.12 (6)		
基金合同存续期		不定期		
下属分级基金的基金简	称:	中金纯债 A	中金纯债 C	
下属分级基金的交易代	码:	000801	000802	
报告期末下属分级基金	的份額总額	104,230,372.17 份	43,121,889.95 😚	
2.2 基金产	品说明			
投资目标	在有效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。	
投资策略	本基金在对宏观经济运行状况、货币政 类资产比例,结合收益率水平曲线形态	策、利率走势和证券市场政策等研究的基础上,自上而下地决定债券组合久期、动态调整名分析和类属资产相对估值分析,优化债券组合的期限结构和类属配置。		
业绩比较基准	中证全债指数			
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。	
2.3 基金管	理人和基金托管人			

2.4 信息披露方: 

				<b>亚侧甲亚:八氏川</b>
3.1.1 期间数据和指标	2015	年	2014年11月4日(基金合同	生效日)-2014年12月31日
	中金纯债 A	中金纯债 C	中金纯债 A	中金纯债C
本期已实现收益	14,078,203.69	2,894,931.80	4,980,136.57	931,274.05
本期利润	14,728,795.26	3,101,711.19	6,027,771.26	1,481,751.28
加权平均基金份额本期利润	0.0735	0.0709	0.0067	0.0078
本期基金份額净值增长率	7.62%	7.13%	1.10%	1.00%
3.1.2 期末数据和指标	2015	手来	2014	年末
期末可供分配基金份额利润	0.0807	0.0750	0.0060	0.0051
期末基金资产净值	113,376,151.93	46,659,939.88	568,226,560.33	153,497,493.63
期末基金份額净值	1.088	1.082	1.011	1.010
注:1、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)
相关费用后的全频	太 田 利 润 为 太 田 口	空和   佐女加   上木甘	11八分价估亦动协2	<u> </u>

2、本报告所列示的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学; 3.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数; 4、本基金合同于2014年11月4日生效,合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计

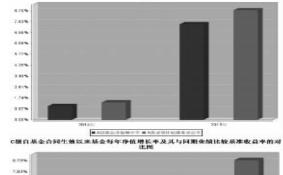
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金 中金纯债		(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	份額净值增长率 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	2.06%	0.08%	2.75%	0.07%	-0.69%	0.01%
过去六个月	4.51%	0.07%	5.39%	0.07%	-0.88%	0.00%
过去一年	7.62%	0.10%	8.74%	0.08%	-1.12%	0.02%
自基金合同生效起 至今	8.80%	0.10%	10.25%	0.10%	-1.45%	0.00%
中金纯债	C					
阶段	份額净值增长率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
过去三个月	1.88%	0.08%	2.75%	0.07%	-0.87%	0.01%
过去六个月	4.34%	0.07%	5.39%	0.07%	-1.05%	0.00%
过去一年	7.13%	0.10%	8.74%	0.08%	-1.61%	0.02%
自基金合同生效起	8 20%	0.10%	10.25%	0.10%	_2.05%	0.00%

- 2056 | 0.1056 | 0.1056 | 0.0056 | - 2056 | 0.0056 | 上: 本基金的业绩比较基准为.中证全债指数。 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



注:本基金的基金合同生效日为2014年11月4日。按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时及本报告期末本基金的各项投资组合比例符合基金合同的 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对 比图



注:本基金合同生效日为 2014 年 11 月 4 日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
根据基金相关法律法规和基金合同的要求,结合本基金实际运作情况,自成立以来本基金未进行的产品和

§4 管理人报告

41 基金管理人及基金经理情况 4.1 基金管理人及基金经理情况 4.11 基金管理人及基金经理情况 4.11 基金管理人及其管理基金的经验 中金基金管理有限公司(简称"中金基金"、"公司")成立于 2014 年 2 月,由中国国际金融股份有限公司(简称"中金公司")作为全资股东,是证监会批准设立的第 90 家公募基金公司,也是首多面过发起设立方式由单一股东持股的基金公司,注册资本 2 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行,致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金管理有限公司注册地址为北京市南阳区建国门外大省 1号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室 ,办公地址为北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层。 蚕至 2015 年 12 月 31 日、公司旅下共管理 4 交开放式基金—中金现金管家货币市场基金、中金纯质债券型证券投资基金,中金地大坡金票的工资,是不是不是一个企业,是一

4.1.2 基金	6经理(或基金	全经理小组)及	基金经理助理简介		
姓名	(日本基金的基金经理(助理)期限 取务	证券从业年限	说明		
X1.4s	81(3)	任职日期	高任日期	RE 92-05-3E-11-PR	0091
石云峰	本基金的基金经理	2014年 11 月 4 日	-	9	石学邮贷员股份建立公司金担任的股份,在1900年的股份,由1900年的

注:1、任职日期说明:任职日期为基金合同生效日; 2、证券从业年限的计算标准: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》

注:1,任职日期的用,任职日期为基金合同生效日;
2,证券从业年限的计算标准,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,
3,本基金无基金经理助理。
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),《证券投资基金运压公平交易制度指导意见)、《基金管理公司开展投资,研究活动防挖内幕交易指导意见)、基金合同和其他法律法规,本着诚实信用 勤勉尽责 安全高效的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有报害基金份额持有人利益行为。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度和控制方法本基金管理人目传能了的规定,制定了不是基金管理办法》对投资决策的内部控制,第一次平交易实施效果评估,信息披露与报告制度等多方面进行了规定,公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第平实的交易安集方面享有公平交易制度和选为对投资决策分而更多人发资组合,产量直接或通过第平实的交易安集方面专行公平的进行利益输送。为保证各投资组合,产量直接或通过第三方的交易安集方面享有公平的制会。公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易使意及流程,加强交易抗行环节的内部控制,并通过工作制度,流程和技术手段保证公平交易可见的实现。同时,通过对投资交易行为的监控,分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。
4.3.2 公平交易制度的执行情况本基金管理人一直坚持公平对特旅下所有投资组合,严格执行证监会(证券投资基金管理人可公平交易制度的执行情况本基金管理人一直坚持公平对特殊下所有投资组合,严格执行证监会(证券投资基金管理公司公平交易制度的规定。

## 中金纯债债券型证券投资基金

## **2015** 年度 报告摘要

2015年12
4.3.3 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。
本报告期内,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 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
1.4.5 为六年来新低,PPI全年同比下降5.2%。国际方面,2015 年 宇宙经济整体处于弱势,2015 年 全年 CIP 同比增长 6.9%,较 2014 年的
7.3%有所下滑。2015 年 物价维持较低水平 全年 CPI 同比雅格为 1.4% 为六年来新低,PPI 全年同比下降5.2%。国际方面,2015 年美国经济温和复步,并在2015年 12 月加息一次,原油及其他大宗商品价格大幅回落,资金流出部分新兴经济体。在国内经济增速继续下滑,宏观指标总体继续趋缓的背景下。宏观调接绝增长和调结场中重,央方策、510 MLF 和 SLF 等定向放松和下调基准利率的货币政策。2015 年全年降息 5 次,降准 4 次。 6 资券市场全年表现优异,债券到期收益率震荡下行。10 年期国债收益率全年下行 80BP 左右至2.8%左右水平,1 年期国债收益率全年下行 66BP 至 2.3%左右水平,中南等级信用利差继续缩窄,低等级信用利差扩大。
报告期内,本着稳健投资原则,本基金在风险和收益之间进行平衡,在追求相对稳定的投资收益前提下,重点配置了国债和中高等级信用债。
4.4.2 报告期内,本着稳健投资原则,本基金在风险和收益之间进行平衡,在追求相对稳定的投资收益前提下,重点配置了国债和中高等级信用债。
4.4.2 报告期内,本金纯债 A 类份额净值增长率为 7.62%,中金纯债 C 类份额净值增长率为 7.13%。同则业绩比较基准收益率为 3.74%。
4.5 管理人对安观整的设备发济,进场市场及行业走势的简要展望
展望 2016年,国际方面,美国经济和美联储格成为全球资格和风险,1.1%的资格,1.1%的资格,1.1%的资格,1.1%的资格,1.1%的资格,1.2%的资格,1.2%的资格,1.2%的资格,1.2%的资格,1.2%的资地产去库存会是 2016年的宏观主题。政策方面,在经济较弱和经济结构、1.2%的资地产生库存会是 2016年的宏观主题。政策方面,在经济较弱和经济结构。1.2%的资本还等的是人是人而形态能力加大,货币政策可能会有所顾虑。央行需要在汇率政策与利率政策间寻求平衡,这可能会影响到货币政策

17 17 4%。 总体来看,我们认为宏观基本面和政策面是有利于债券市场的,但我们也关注可能存在的积 

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
本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金》、基金合同、托管协议和其他有关规定、不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责
履行了基金托管人应尽的义务。
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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定、对本基金的基资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。
报告期内,本基金未实施利润分配。
5.2 期内,本基金未实施利润分配。
在第6人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人发核审查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、投资组程生生态必须保证与核协会不存在常用可求。以是性联动被考末、涉漏

财务报表是否经过审计		문		
审计意见类型		标准无保留意见		
审计报告编号		毕马威华援审字第 1600913 号		
6.2 审计报告的基本区	勺容			
审计报告标题		审计报告		
审计报告收件人	中金纯信	债债券型证券投资基金全体基金份额持有人		
引言段	2015年	计了中金纯债债券型证券投资基金(以下商称"该基金")财务报表,包括 2014年 12 月 31 日及 12 月 31 日前读产价债表,目 2014年 11 月 4 日 任金全同生效日 12 2014年 12 月 31 日止期间 年度的利润表现所看看收益(基金净值)发动表以及财务规表附法。		
管理层对财务报表的责任段	按照中年 协会发布	公允列报财务报表是该基金管理人中金基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1) 华风民共和国财政部第市的企业会计准则和中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业 市的有关基金行业主务操作的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计,执行和维护 内部控制,以使财务报表不存在由于解除或指误等故的重大情况。		
注册会计师的责任段	的规定的 和执行日 审计 于注册册 经 时,注册 经 的有以及	据任总是比许市计工作的基础上支撑多型成次发布计量度。我们按键中型进程会计模设计操作。 现代了特工化,但这些是全价等计算的现象来我们写了中世是会计算等。这种 特工作以对转步则表是也不存在量大组组投资之理操证。 计工作设定其编计程序,以报政代总外表设金额和设备的一种证据。选择的审计程序政决 为上标的方规程。但据自由了解决也指导等或负责的发现着大量原列的时代。进步行成合社会 并成为一种的发展。 是一种发展。 是一种发展。 是一种发展。 是一种发展, 是一种发展。 是一种发展, 是一种发展。 是一种发现象。 是一种发展。 是一种发现象。 是一种发现象。 是一种发现象。 是一种发现象。 是一种发现象。 是一种发现象。 是一种发现象。 是一种发现象。 是一种发现象。 是		
审计意见段	报表附注操作的规	为,该基金财务根表在所有重大力需按照中华人民共和国财政高领布的企业会计准则和以财务 让中所列汽的中国还参监督经理委员会和中国业务投资基金业协会发布的有关基金产业务 级强领别 公杰安康 污脓金 2014年12月3日及2015年72月3日日的安全, 4日日高金合同生农日)至 2014年12月31日止期间及 2015年度的经营成果和基金净银变动		
注册会计师的姓名	程海良	黄艾舟		
会计师事务所的名称	毕马威华	华振会计师事务所 (特殊普通合伙)		
会计师事务所的地址	中国北京	京东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层		
由计报告日期	2016年 2	2016年 3 月 24 日		

7.1 资产负债表 会计主体:中金纯债债券型证券投资基金 报告截止日: 2015年12月31日

资产	附注号	本期末 2015年 12 月 31 日	上年度末 2014年 12 月 31 日
资产:			
根行存款		248,153.26	15,586,346.78
结算备付金		3,000,434.72	11,408,748.39
存出保证金		15,957.42	18,057.52
交易性金融资产		178,854,521.74	691,986,156.80
其中:投票投资		_	
基金投资		_	
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		178,854,521.74	691,986,156.88
资产支持证券投资		-	
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买人返售金融资产		-	3,000,000.00
应收证券清算款		594,765.07	3,497,049.3
应收利息		2,227,641.50	11,690,410.6
应收股利			,000141000
应收申购款		51,975.15	154,158.7
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		_	
其他资产		_	
资产总计		184,993,448.86	737,340,928.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年 12 月 31 日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		_	
交易性金融负债		_	
衍生金融负债		_	
实出回购金融资产款		24,200,000.00	
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		247,666.02	14,832,140.4
应付管理人报酬		78,347.54	553,842.20
应付托管费		22,385.00	158,240.60
应付销售服务费		8,646.31	60,560.60
应付交易费用		1,225.00	3,359.80
应交税费			
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		399,087.18	8,730.40
负债合计		24,957,357.05	15,616,874.3
所有者权益:			,0101074.55
实收基金		147,352,262.12	714,362,861.92
<b>米分配利润</b>		12,683,829.69	7,361,192.0
所有者权益合计		160,036,091.81	721,724,053.90
负债和所有者权益总计	1	184,993,448.86	737,340,928.2

間 1.088 元(2014 年 12 月 31 日 : 八七市 1.010 元) 法金份额资金额为 147,352 262.12 份(2014 年 12 月 31 日 : 八七市 1.010 元) 法金份额资额为 147,352 262.12 份(2014 年 12 月 31 日 : 714,362,861.92 份),其中中金纯债基金 A 类基金份额为 104,230,372.17 份(2014 年 12 月 31 日 : 562,321,253.05 份);中金纯债基金 C 类基金份额为 43,121,889.95 份(2014 年 12 月 31 日:152,041,608.87 份)。

			单位:人民币
項目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	2014年11月4日(基金合同生效日)至 2014年12月31日
一、收入		22,298,521.71	9,186,018.26
1.利息收入		16,102,549.81	7,288,037.33
其中:存款利息收入		159,789.91	2,687,524.02
债券利息收入		15,938,008.64	2,989,340.31
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收入		4,751.26	1,611,173.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益(損失以=="填列)		5,202,542.41	75,913.01
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	_
债券投资收益		5,202,542.41	75,913.01
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)		857,370.96	1,598,111.92
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(損失以"-"号填列)		136,058.53	223,956.00
减:二、费用		4,468,015.26	1,676,495.72
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	1,811,821.28	1,180,577.96
2.托管费	7.4.8.2.2	517,663.24	337,307.99
3.销售服务费	7.4.8.2.3	185,837.39	118,205.39
4.交易费用		13,832.68	4,852.33
5.利息支出		1,499,292.47	27,866.12
其中:卖出回购金融资产支出		1,499,292.47	27,866.12
6.其他费用		439,568.20	7,685.93
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		17,830,506.45	7,509,522.54
减,所得税费用		-	
四,净利润(净亏损以*-*号填列)		17,830,506.45	7,509,522.54

注:本基金合同生效日为2014年11月4日。 7.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:中金纯债债券型证券投资基金 本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

			单位:人民币5
項目	5	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	实收基金	米分配利润	所有者权益合计
、期初所有者权益(基金净值)	714,362,861.92	7,361,192.04	721,724,053.96
:、本期经营活动产生的基金净值变动数 本期净利润)	-	17,830,506.45	17,830,506.45
、本期基金份額交易产生的基金净值变 数 (净值减少以~-~号填列)	-567,010,599.80	-12,507,868.80	-579,518,468.60
中:1.基金申购款	122,608,373.64	6,936,369.61	129,544,743.25
基金赎回款	-689,618,973.44	-19,444,238.41	-709,063,211.85
1、本期向基金份額持有人分配利润产生 3基金净值变动(净值减少以~-*号填列)	-	-	-
、期末所有者权益(基金净值)	147,352,262.12	12,683,829.69	160,036,091.81
项目	2014年 11	上年度可比期间 月4日(基金合同生效日)至2014年12月	31 ⊟
	实收基金	米分配利润	所有者权益合计
、期初所有者权益(基金净值)	1,255,808,243.86	-	1,255,808,243.86
、本期经营活动产生的基金净值变动数 本期净利润)	-	7,509,522.54	7,509,522.54
、本期基金份額交易产生的基金净值变 )数 (净值减少以"-"号填列)	-541,445,381.94	-148,330.50	-541,593,712.44
中:1.基金申购款	3,035,154.58	6,478.01	3,041,632.59
基金赎回款	-544,480,536.52	-154,808.51	-544,635,345.03
1、本期向基金份額持有人分配利润产生 D基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
(期末所有者权益(基金净值)	714.362.861.92	7.361.192.04	721.724.053.96

7.4 报表附注
7.4.1 基金基本情况
中金纯债债券型证券投资基金(以下简称"本基金")依据中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")于2014年8月19日证监许可[2014]869号(关于核准中金纯债债券型证券投资基金达册的批复)核准。由中金基金管理有限公司(以下简称"中金纯债债券型证券投资基金法》)及配套规则和(中金纯债债券型证券投资基金基金合同)公开募集。本基金为契约型开放式,存纳期限为不定期。本基金的管理人为中金基金、托管人为中国建设银行股价有限公司(以下简称"建设银行")本基金通道销柜台、建设银行及中国国际金融股份有限公司(以下简称"建设银行")本基金通过管理人中金基金直销柜台、建设银行及中国国际金融股份有限公司(以下简称"中金纯债债券型证券投资基金基金合同》于2014年11月4日正式生效,基金合同生效日基金实收份额为1.255.808.243.86份(含书包集中领部46.31943份),发行价格为人民币1.00元。该资金的日申马威华联会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。根据经中国证监会备案的(中金纯债债券型证券投资基金基金合同和《中金纯债债券型证券投资基金基金合同和《中金纯债债券型证券投资基金基金台同和《中金纯债债券型证券投资基金报查记师和《中金纯债债券型证券投资基金报查记》和《中金纯债债券型证券投资基金报案员用书》的相关内容、本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购,申购的,收取认购,申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的、称为 A 类基金份额,不收取认购,申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的、称为 C 类基金份额和 C 类基金份额和 C 类基金份额价别设置代码。由于基金费用的不同、本基金 A 类基金份额,不收取认购,1 申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的、称为 C 类基金份额和 C 类基金份额别的公告,计算日各类别基金资产净值除以计算日发售和经验基金资产净值除以计算也发售在外的该类别基金份额净的公告,与

公式为计算日各类别基金资产争值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可目行选择认购/申购的基金份额类别。根据(中华人民共和国证券投资基金法)及其配套规则、《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》和《中金纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为固定收益类金融工具、包括:国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、公司债、企业债、可转换债券、中期票据、资产支持证券、短期融资券、债券回购和银行存款等局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或增发新股,仅可持有因贝克的养好股所形成的股票、因所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个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。74.2 会计报表的编制基础

机构以后允许基金投资其他品种,基金官理人在履行适当程序后,可以将其羽入投资范围。 7.4.2 会计报表的编制基础 本财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求 编制。在具体会计核算和信息披露方面,同时亦按照证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年 度》 (正监会正式篇)(2015年12月22日)和中国证券投资基金业协会于 2012年 11月16日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。 本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。
7.4.3 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以及附注所述的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布
的有关基金行业实务操作规定的要求,真实,完整地反映了本基金 2014 年 12 月 31 日及 2015 年
12 月 31 日的财务状况,自 2014 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间及
2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。
7.4.4 重要会计政策和会计估计
7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
7.4.5.1 会计政策变更的说明
本基金本报告期会计政策变更的说明在会计报表的编制基础中披露。
7.4.5 会计估计率面的说明

本基金本报告期宏以取取及之际。 7.4.5.2 会计估计变更的说明 本基金本报告期末未发生会计估计变更。

、第 20%的 个人所待忧。 (d)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, 暂不征收个人所得税和

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
建设银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构

下企大联交易均根据止吊的商业交易率针进行,并以一; 74.8.1 通过关联方交易单元进行的交易 74.8.1.1 股票交易 本基金本报告期与上年度可比期间无关联方股票交易。

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年11月4日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
大軟刀石称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券 成交总额的比例
	964,709,351,33	100.00%	429.047.539.90	100.009
7.4.8.1.3 债券回	1购交易	100.00%	金额	
	I购交易		金额	单位:人民币
	1购交易		金额	单位:人民币

本基金 2015 年度及自 2014 年 11 月 4 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日均无应支付关联方的佣金。 7.4.8.2 关联方报酬

			单位:人民币元
	項目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年11月4日(基金合同生效日)至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,811,821.28	1,180,577.96
	其中,支付销售机构的客户维护费	1,057,385.85	847,349.35
技			一日基金资产净值 0.70%的年费率计 里费=前一日基金资产净值×0.70%/当
-	a med state		

年天数。 7.4.8.2.2 基金托管费 单位:人民币元 上年度可比期间 2014年11月4日(基金合同生效日)至2014年12月31日

注:支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提 逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为;日基金托管费=前一日基金资产净值x0.20%/当年天

7.4.8.2.3 销售服务费			单位:人民币
获得销售服务费的		本期 2015年1月1日至2015年12月:	il H
各关联方名称		当期发生的基金应支付的销售服	<b>务</b> 贽
	中金纯债 A	中金纯债C	合计
中金基金	-	7,996.05	7,996.05
中国建设银行	-	172,105.97	172,105.97
中金公司	-	1,973.59	1,973.59
合计	-	182,075.61	182,075.61

(元山东山)以上河口19年2日年八地市田中京並仅以平基並即消化 2015年度以及自2014年11月4日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间內,基金管理人未运用固有资金投资本基金。 7.4.8.4.2 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

△□ 27,803,521.78 18,8700% - 注:2014 年 12 月 31 日,除基金管理人之外的其他关联方未运用固有资金投资本基金。 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入 本期 2015年1月1日至2015年12月31日 关联方 名称

未在承销期内参与关联方承销证券。 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

/48./ 共他大联交易事项的记明 本基金本报告期无其他关联交易事项。 7.4.9 期末(2015 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 本基金于 2015 年 12 月 31 日及 2014 年 12 月 31 日无因认购新发 / 增发证券而于年末持有 的流通受限证券。 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 本基金卡报生期主共共有新时位随至海流 本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末未发生银行间市场债券正回购交易(2014年12月31日:同)。
7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
截至 2015年12月31日,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 24,200,00000元(于 2014年12月31日;零),于 2016年1月4日到期,该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,低于债券回购交易的余额。
7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
(a)公允价值计量的层次下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的是低层次的输入值。全人层次输入值的定义如下:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第三层次输入值。相关资产或负债的不可观察输入值。

i)金融工具公允(	介值计量的方法			
		2015年12月31日		单位:人民币:
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产	-	-	-	-
债券投资	122,105,021.74	56,749,500.00	-	178,854,521.74
合计	122,105,021.74	56,749,500.00	-	178,854,521.74
		2014年12月31日		单位:人民币:
	第一层次	第二层次	第三层次	合计
交易性金融资产	-	-	-	-
债券投资	349,004,156.88	332,982,000.00	10,000,000.00	691,986,156.88
合计	349 004 156 88	332 982 000 00	10 000 000 00	691 986 156 88

分計 389,004,156.85 325,902,000.00 10,000,000.00 691,996,156.08 对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息,本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设详见附注。
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债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况、本基金分别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债券的公允价值列人第二层次或第三层次,上述事项解除时将相关债券的公允价值列人第一层次。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融资产的公允价值所属层次未发生重大变动。
iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额 本基金于2015年12月31日无公允价值归属于第三层级的金融工具。本基金于2014年12月31日行约公允价值归属于第三层次的金融工具为未上市企业债。(b)其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

价值之间无重大差异。

8 1	期末基金资产组合情况					
0.1	WALES OF STEEL HOLD	金额单位:人民币元				
字号	項目	金額	占基金总资产的比例(%)			
1	权益投资	-	-			
	其中:投票	-	-			
2	固定收益投资	178,854,521.74	96.68			
	其中:债券	178,854,521.74	96.68			
	资产支持证券	-	-			
3	贵金属投资	-	-			
4	金融衍生品投资	-	-			
5	买人返售金融资产	-	-			
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-			
6	银行存款和结算各付金合计	3,248,587.98	1.76			

8 6年 82. 期末按行业分类的股票投资组合 82.1 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资产。 82.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合 本基金本报告期末未持有沪港通投资股票投资组合

不能处于以口吻小小对目广带型权项权票。 8.3 期末核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 本基金本报告期末末持有股票资产。

0.0	<b>州小以贝尔吅TT刀大时贝尔以</b>	以注 口	
		ś	金额单位:人民币
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	66,053,554.00	41.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,421,000.00	6.51
	其中:政策性金融债	10,421,000.00	6.51
4	企业债券	69,713,240.54	43.56
5	企业短期職资券	-	-
6	中期票据	31,268,000.00	19.54
7	可转债(可交换债)	1,398,727.20	0.87
8	同业存单	-	
9	其他	-	-
10	AH	170 954 521 74	111.76

8.7 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本基金本报告期末未持有资产支持证券。 8.8 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投资 8.9 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投资。

本基金率取已初水水污有权证该以。 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 8.111、本期国债期货投资政策 本基金本报告期末未持有国债期货。 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查,或在本报告编前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

		单位:人民
序号	名称	金額
1	存出保证金	15,9
2	应收证券清算款	594,7
3	应收股利	
4	应收利息	2,227,6
5	应收申购款	51,9
6	其他应收款	
7	待推费用	
8	<b>共他</b>	
9	合计	2,890,3

由于四舍五人原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差 \$9 基金份额持有人信息 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

		持有人户数 (户)				持有人结	构		
份额级别				:份額 机构投资者		者		个人投资者	
	(- /			持有份額		占总份额比例	持有份額		占总份额比例
中金纯债 A	359	290,	335.30	0 60,584,839.79		58.13%	43,	43,645,532.38	
中金纯债C	158	272,	923.35		27,803,521.78	64.48%	15,	318,368.17	35.52%
合计	517	285,	014.05		88,388,361.57	59.98%	58,	963,900.55	40.02%
9.3	胡末基金管	理人的从	业人	员持有:	本基金的信	况			
	項目		6	額級別		持有份額总数(份)		占基金	总份额比例
		中	金纯债 A	3,053,309.51 2.92			2.9294%		
基金管理人所有从业人员持有本基金			中	金纯债 C	51,03		51,038.62		0.1184%
				合计			3,104,348.13		2.1068%
9.4	胡末基金管	理人的从	业人	.员持有:	本开放式基	金份额总量区	间的情况		
	項目			份额给	级别	持有基	金份额总量的数量	区间(万份)	
				中金纯债 A					>100
本公司高級管理人员、基金投资和研究部门负 责人持有本开放式基金			中金纯债C					0~10	
				合计	+				>100
				ala A Ala	. Adm				

份额单位:份

910 开双式	, 型 玉 切 砌 支 勾				
单位:					
項目	中金纯债 A	中金纯债C			
基金合同生效日(2014年11月4日)基金份额总额	1,053,652,047.95	202,156,195.91			
本报告期期初基金份额总额	562,321,253.05	152,041,608.87			
本报告期基金总申购份额	75,050,935.62	47,557,438.02			
减:本报告期基金总赎回份额	533,141,816.50	156,477,156.94			
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-			
本报告期期末基金份额总额	104,230,372.17	43,121,889.95			
注:报告期期间基金总申购份额含红利再挤	&、转换人份额;基金总赎[	回份额含转换出份额。			

§11 重大事件揭示 11.1 基金份额持有人大会决议 本基金本报告期内,本基金米召开联企品等等于

	11.2 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
	2,3015年8月14日、營中企基金管理有限公司第一届新聯合第八九合议建议通过。各类罗亚先生搬包处理职务。 2,2015年9月2日、抗中金金金管理有限公司第一届新李宗加入公院收益进行。在任务委士力公司额已经理。 3,2015年12月31日、松中金基金管理有限公司第一届董事会第九次会议审议通过。总处理剩害先生案任,由外青女士继任公司总经理。孙青女士同时 经期间总经任任职。
	4。2015年12月3日,馬斯中企基金股东中国防企業股份有限公司股东决区、任命各等之土力中金监企署。H属联合重新"A企业周季先生中企业基金署 福群市金寨年程,是投资制作。公司宪委任选增加,经任金、股市公司企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业企业
-	11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
	本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
	11.4 基金投资策略的改变

11.7 <u>SELIX X X PILLINX X</u>
本基金本报告期内基金投资策略未发生改变。
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
本基金的审计机构为华马威华聚会计师事务所(特殊普通合伙),该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务,无改聘情况。本基金本报告期内应约付审计费用 90,00000元。
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查和处罚。
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
1171 其全租田证券公司农县单元进行股票投资及佣金支付情况

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需 要;
(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于,有较好的研究能力和行业分析能力,能及时,全面地向公司提供高质量的关于宏观,行业及市场走向,个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特殊要求,提供专门研究报告,能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
3.基金交易单元的选择程序如下;
(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
(2) 其全经理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议

11.7.2 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									
	债券	交易	债券回购交	85	权证3	2.局			
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券回 购 成交总额的比 例	成交金額	占当期权证 成交总额的比例			
中金公司	964,709,351.33	100.00%	11,072,771,000.00	100.00%	-	-			