新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

【2014】年度报告摘要

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年三月二十七日

§1 重要提示

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。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月20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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务材料已经审计。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华纯债添利债券发起	
基金主代码	519152	
交易代码	519152	
基金运作方式	契约型开放式基金	
基金合同生效日	2012年12月21日	
基金管理人	新华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,957,297,307.69份	
下属分级基金的基金简称	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
下属分级基金的交易代码	519152	519153
报告期末下属分级基金的份额总额	1,765,344,710.30份	191,952,597.39份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对债券组合的久期、期限结构、类属品种以及单个债券进行积极主动的配置,力争在严格控制投资组合风险的同时,提高基金资产的流行性及收益率水平,为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	基金的投资策略主要包括:利率预期策略、类属品种配置策略以及证券选择策略。采用定量与定性相结合的研究方法,深入分析市场利率发展方向、期限结构变化趋势、信用主体评级水平以及单个债券的投资价值,积极主动进行类属品种配置及个券选择,谋求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中债新综合指数(全价)。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、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

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	赵会军
	联系电话	010-88423386	010-66105799
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95588
传真		010-88423310	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014年		2013年		2012年12月21日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
本期已实现收益	50,573,279.44	40,911,676.63	11,392,469.08	76,395,041.31	707,873.02	4,664,856.19
本期利润	41,545,346.70	81,824,144.61	6,976,136.95	53,968,621.85	745,624.47	4,937,160.60
加权平均基金份额本期利润	0.0751	0.1570	0.0378	0.0401	0.0013	0.0012
本期基金份额净值增长率	17.96%	17.55%	1.80%	1.30%	0.10%	0.10%

3.1.2期末数据和指标	2014年末		2013年末		2012年末	
	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
期末可供分配基金份额利润	0.1024	0.0934	0.0187	0.0135	0.0013	0.0012
期末基金资产净值	2,121,962,573.90	228,853,627.10	60,935,286.84	235,639,068.06	560,079,245.19	4,039,745,187.41
期末基金份额净值	1.202	1.192	1.019	1.014	1.001	1.001

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)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;

2、以上所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(例如基金申购费赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润,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的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

1. 新华纯债添利债券发起A类:

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
过去三个月	2.39%	0.09%	1.66%	0.17%	0.73%	-0.08%
过去六个月	5.72%	0.08%	2.38%	0.13%	3.34%	-0.05%
过去一年	17.96%	0.16%	6.56%	0.11%	11.40%	0.05%
自基金合同生效起至今	20.20%	0.14%	2.84%	0.10%	17.36%	0.04%

2. 新华纯债添利债券发起C类:

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
过去三个月	2.32%	0.09%	1.66%	0.17%	0.66%	-0.08%
过去六个月	5.49%	0.08%	2.38%	0.13%	3.11%	-0.05%
过去一年	17.55%	0.16%	6.56%	0.11%	10.99%	0.05%
自基金合同生效起至今	19.20%	0.13%	2.84%	0.10%	16.36%	0.03%

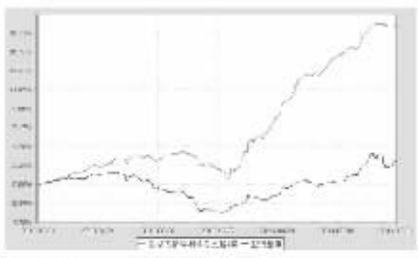
1、本基金债券投资部分的业绩比较基准采用中债新综合指数(全价)。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

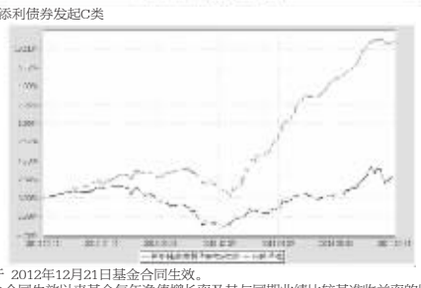
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年12月21日至2014年12月31日)

1、新华纯债添利债券发起A类



2、新华纯债添利债券发起C类

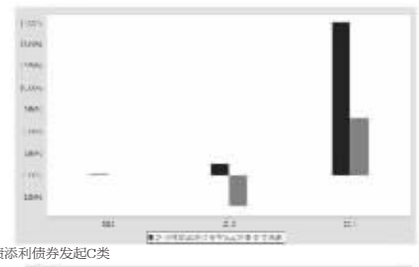


注:本基金于 2012年12月21日基金合同生效。

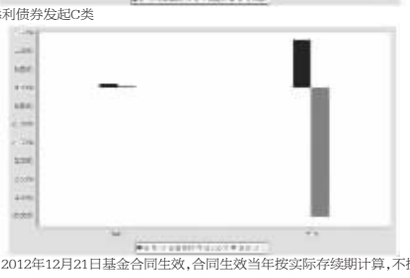
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1、新华纯债添利债券发起A类



2、新华纯债添利债券发起C类



注:本基金于 2012年12月21日基金合同生效,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

本基金于 2012年12月21日基金合同生效,于2014年12月31日未进行过利润分配。

§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

新华基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批复,于2004年12月9日注册成立。注册地为重庆市,是我国西部首家基金管理公司。

截至2014年12月31日,新华基金管理有限公司旗下管理着二十三只开放式基金,即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业股票型证券投资基金、新华行业周期轮换股票型证券投资基金、新华中小市值优选股票型证券投资基金、新华灵活主题股票型证券投资基金、新华优选消费股票型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航股票型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华信用增益债券型证券投资基金、新华惠鑫分级债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华阿里一号保本混合型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华财富金30天理财债券型证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华活期添利货币市场基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
于泽雨	本基金基金经理、新华基金管理有限公司固定收益部副总监、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理。	2012-12-21	-	6	经济学博士,6年证券从业经验。历任华安财产保险公司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理,于2012年10月加入新华基金管理有限公司。现任新华基金管理有限公司固定收益部副总监、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理。
资兴振	本基金基金经理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华中小市值优选股票型证券投资基金基金经理、新华惠鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华财富金30天理财债券型证券投资基金基金经理。	2012-12-21	2014-01-02	7	经济学硕士,7年证券从业经验。历任北京城市系统工程研究中心研究员。资兴振先生于2007年9月加入新华基金管理有限公司,先后负责研究煤炭、电力、金融、通信设备、电子和有色金属等行业,担任过策略分析师、债券分析师。现任新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华中小市值优选股票型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理、新华财富金30天理财债券型证券投资基金基金经理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。

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,新华基金管理有限公司作为新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它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持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易,投资指令统一由交易部下达,并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议,由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令,交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《新华基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

基金管理人对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内以及5日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明:债券同向交易频率偏低;股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断,即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大,结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生,本报告期内,未发生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成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

2014年元旦后市场需求依旧疲弱,一级市场中标利率高企。2月份春节过后,市场出现超预期变化,配置性需求大量涌出,一二级市场收益率快速下行。二季度,随着各项增长数据的陆续公布,经济下行压力逐步显现,市场预期未来资金的回报率将逐步降低,货币信贷政策将趋于宽松,对债券资产的配置需求相应增加。7月初开始债券市场出现调整,其中利率债调整相对明显,城投债受冲击相对较小。9月中旬,随着8月份各项经济数据低于预期,显示经济调整压力仍较大,以及央行采取降低利率、定向再贷款等措施后,市场情绪明显乐观,收益率出现快速且大幅度的下行。11月底是全年债券市场的顶峰。10年国债从年初的4.6%下行到11月底的3.5%;10年金融债从年初的5.9%下行到11月底的3.7%;中债七年期AA城投债到期参考收益率,从1月中的全年高点8.15%一路下探到11月底的5.5%,下行近270个基点。就在市场讨论降息通道打开的时候,债券收益率却在降息兑现后出现大幅调整。在操作上,本基金在前三季度坚持较高杠杆操作,品种主要专注于中等资质以上城投债,立足于较高的票息收益和利差收益,取得了较好的阶段性收益。随着10-11月长端品种收益率水平的进一步下降,本基金逐步降低了组合的杠杆比例和久期,逐步增强了组合的流动性和收益的稳定性。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金A类份额净值为1.202元,本报告期份额净值增长率为17.96%,同期比较基准的增长率为6.56%;本基金B类份额净值为1.192元,本报告期份额净值增长率为17.55%,同期比较基准的增长率为6.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前债市处于震荡阶段,利好和利空因素均有所体现,未来走势的不确定性增强。具体来讲,经济短期企稳但后续能否同升仍存在疑问,通胀压力暂缓但长期通胀压力尚存,货币政策面临稳增长和调结构控风险的两难,新股发行、缴准和信贷投放等时点性因素对资金面影响增大,并增加债市波动的压力。从收益率水平来看,尽管目前收益率水平较历史低位还有空间,但随着利率市场化推进,收益率曲线的整体下行可能存在制约。总体上目前债市尚未出现明显的行情展开路径,短期内债市可能处于波动中。近期在策略上不主动激进,主要配置流动性较高的债券,缩减久期并控制杠杆,规避流动性较差的信用债,以提高投资组合的灵活度。同时,密切关注资金面波动,在控制风险的前提下,考虑把握阶段性的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工

4.6.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责:

① 制定估值制度并在必要时修改;

② 确保估值方法符合现行法规;

③ 批准证券估值的步骤和方法;

④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长,运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下,可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

4.6.1.2 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后,基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告,至少每月一次。

基金会计职责:

① 获得独立、完整的证券价格信息;

② 每日证券估值;

③ 检查价格波动并进行一般准确性评估;

④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动,并在必要时向估值工作小组报告;

⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录;

⑥ 对估值调整和人工估值进行记录;

⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要,可以提议召开估值工作小组会议。

4.6.1.3 投资管理部的职责分工

① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯;

② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告;

④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.6.1.4 交易部的职责分工

① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应;

② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

4.6.1.5监察稽核部的职责分工

① 监督证券的整个估值过程;

② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

③ 确保公司的估值制度和方法符合现行法律、法规的要求;

④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险;

⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯;

⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

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。

§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

本报告期内,本基金托管人在对新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地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

本报告期内,新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的管理人——新华基金管理有限公司在新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,新华纯债添利债券型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管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

本托管人依法对新华基金管理有限公司编制和披露的新华纯债添利债券型发起式证券投资基金2014年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2015年3月20日

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师李荣坤、张吉范签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:	-	-
银行存款	9,868,907.70	7,533,168.00
结算备付金	4,482,699.25	8,840,337.13
存出保证金	137,148.45	105,977.83
交易性金融资产	2,184,234,123.42	595,222,186.70
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,184,234,123.42	595,222,186.70
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	112,500,569.00	-
应收证券清算款	18,783,926.49	-
应收利息	53,147,190.12	12,842,130.89
应收股利	-	-
应收申购款	1,360,564.95	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,384,515,129.38	624,543,800.55
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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	-	320,419,567.49
应付证券清算款	-	1,064,390.27
应付赎回款	30,894,893.31	5,651,239.28
应付管理人报酬	1,581,996.09	187,185.11
应付托管费	527,332.04	62,395.05
应付销售服务费	178,175.06	103,256.96
应付交易费用	37,263.60	14,854.76
应交税费	-	-
应付利息	-	5,805.66
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	479,268.28	460,751.07
负债合计	33,698,928.38	327,969,445.65
所有者权益:	-	-
实收基金	1,957,297,307.69	292,313,184.85
未分配利润	393,518,893.31	4,261,170.05
所有者权益合计	2,350,816,201.00	296,574,354.90
负债和所有者权益总计	2,384,515,129.38	624,543,800.55

注:报告截止日2014年12月31日,A类基金份额净值1.202元,基金份额1,765,344,710.30份,B类基金份额净值1.192元,基金份额191,952,597.39份。

7.2 利润表

会计主体:新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	145,574,656.50	87,088,381.37
1.利息收入	77,289,080.38	101,731,595.13
其中:存款利息收入	259,509.06	14,955,805.31
债券利息收入	74,986,653.36	81,894,282.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,042,917.96	4,881,507.38
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	31,272,994.72	11,249,195.13
其中:股票投资收益	-	0.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	31,272,994.72	11,249,195.13
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)	31,884,535.24	-26,842,751.59
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	5,128,046.16	950,342.70
减:二、费用	22,205,165.19	26,143,622.57
1.管理人报酬	7,333,225.84	9,628,992.79
2.托管费	2,444,408.69	3,209,664.23
3.销售服务费	2,377,496.66	5,646,134.42
4.交易费用	47,216.59	59,733.23
5.利息支出	9,469,440.31	7,035,017.39
其中:卖出回购金融资产支出	9,469,440.31	7,035,017.39
6.其他费用	533,377.10	564,080.51
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	123,369,491.31	60,944,758.80
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	123,369,491.31	60,944,758.80

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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)	292,313,184.85	4,261,170.05	296,574,354.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	123,369,491.31	123,369,491.31
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)	1,664,984,122.84	265,888,231.95	1,930,872,354.79
其中:1.基金申购款	5,933,632,728.09	1,024,255,981.61	6,957,888,709.70
2.基金赎回款	-4,268,648,605.25	-758,367,749.66	-5,027,016,354.91
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)	1,957,297,307.69	393,518,893.31	2,350,816,201.00
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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)	4,594,141,647.53	5,682,785.07	4,599,824,432.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	60,944,758.80	60,944,758.80
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)	-4,301,828,462.68	-62,366,373.82	-4,364,194,836.50
其中:1.基金申购款	2,933,810,931.09	59,068,050.31	2,992,878,981.40
2.基金赎回款	-7,235,639,393.77	-121,434,424.13	-7,357,073,817.90
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)	292,313,184.85	4,261,170.05	296,574,354.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:陈重,主管会计工作负责人:张宗友,会计机构负责人:徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")系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[2012]1325号文核准,由新华基金管理有限公司作为发起人,于2012年11月20日至2012年12月18日向社会公开募集,设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计4,594,141,674.53份,有效认购户数为14,667户,并经国富浩华会计师事务所(特殊普通合伙)国浩验字[2012]404A271号验资报告予以验证。2012年12月21日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金招募说明书》及《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、地方政府债、城投债、金融债、企业债(含中小企业私募债)、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产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。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。同时本基金不参与可转换债券投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金各类资产的投资比例范围为:固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理有限公司于2015年3月26日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制,根据实际发生的交易和事项,按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的41项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华纯债添利债券型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的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的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

7.4.4 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。

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

本基金报告期内未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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》、财税字[2005]107号文《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、自2008年4月24日起执行的《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金买卖股票于2008年4月24日前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税,自2008年4月24日起按0.1%的税率缴纳。经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从2008年9月19日起,调整证券(股票)交易印花税征收方式,将现行的对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据按0.1%的税率对双方当事人征收证券(股票)交易印花税,调整为单边征税,即对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据的出让按0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税,对受让方不再征税。

(5)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、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东
深圳新华富时资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金均无通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,333,225.84	9,628,992.79
其中:支付销售机构的客户维护费	2,930,495.01	5,752,126.99

注:基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.6%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.6%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,444,408.69	3,209,664.23

注:基金托管费按前一日的基金资产净值0.2%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类	合计
中国工商银行股份有限公司	-	497,767.41	497,767.41
新华基金管理有限公司	-	760,155.42	760,155.42
恒泰证券股份有限公司	-	19,166.62	19,166.62
恒泰长财证券有限责任公司	-	1.48	1.48
合计	-	1,277,090.93	1,277,090.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类	合计
恒泰证券	-	197,665.61	197,665.61
新华直销	-	503,606.75	503,606.75
工商银行	-	4,155,364.66	4,155,364.66
恒泰长财证券有限责任公司	-	23,456.36	23,456.36
合计	-	4,880,093.38	4,880,093.38

注:本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%