

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:2015年7月20日

### § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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2015年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、基金资产净值和投资者持有的基金份额，对本基金的定期报告、净值表现、收益分配政策等内存在虚假记载、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。

本报告期未进行份额转换。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

### § 2 基金产品概况

基金名称 中金纯债

基金代码 000801

交易方式 买入、卖出

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

报告期末基金份额总额 148,092,844.36份

投资目标 在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的管理，力求实现基金资产长期稳定的增值。

基金定期报告 本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A 中金纯债C

1.本期已实现收益 2,829,951.97 452,356.89

2.本期利润 4,291,207.72 682,299.31

3.期初平均基金份额净值 0.9240 0.9228

4.期末基金份额净值 1.0255 1.0273

5.期末基金净值 1.041 1.037

注:1.上表已于2015年4月10日经利得基金管理有限公司复核。

2.本期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将有所下降。

3.2 基金的净值表现

3.2.1 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A 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

过去三个月 2.06% 0.12% 2.21% 0.09% -0.15% 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

过去三个月 1.87% 0.12% 2.21% 0.09% -0.34% 0.03%

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

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A 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

过去三个月 5.80% 0.49% 0.45% 0.11% 5.35% 0.48%

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.3.1 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A

1.本期已实现收益 36,219,645.48

2.本期利润 41,217,321.39

3.期初平均基金份额净值 0.9981

4.期末基金份额净值 750,736,781.70

5.期末基金净值 1.0581

注:本基金已实现收益指本基金本期已实现收入、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.本报告期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将有所下降。

3.2.3 基金的净值表现

3.2.1.1 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A

1.本期已实现收益 36,219,645.48

2.本期利润 41,217,321.39

3.期初平均基金份额净值 0.9981

4.期末基金份额净值 750,736,781.70

5.期末基金净值 1.0581

注:本基金已实现收益指本基金本期已实现收入、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.本报告期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将有所下降。

3.2.2.2 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A

1.本期已实现收益 36,219,645.48

2.本期利润 41,217,321.39

3.期初平均基金份额净值 0.9981

4.期末基金份额净值 750,736,781.70

5.期末基金净值 1.0581

注:本基金已实现收益指本基金本期已实现收入、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.本报告期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将有所下降。

3.2.3.2 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A

1.本期已实现收益 36,219,645.48

2.本期利润 41,217,321.39

3.期初平均基金份额净值 0.9981

4.期末基金份额净值 750,736,781.70

5.期末基金净值 1.0581

注:本基金已实现收益指本基金本期已实现收入、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.本报告期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将有所下降。

3.2.4.2 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A

1.本期已实现收益 36,219,645.48

2.本期利润 41,217,321.39

3.期初平均基金份额净值 0.9981

4.期末基金份额净值 750,736,781.70

5.期末基金净值 1.0581

注:本基金已实现收益指本基金本期已实现收入、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.本报告期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将有所下降。

3.2.5.2 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A

1.本期已实现收益 36,219,645.48

2.本期利润 41,217,321.39

3.期初平均基金份额净值 0.9981

4.期末基金份额净值 750,736,781.70

5.期末基金净值 1.0581

注:本基金已实现收益指本基金本期已实现收入、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.本报告期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将有所下降。

3.2.6.2 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A

1.本期已实现收益 36,219,645.48

2.本期利润 41,217,321.39

3.期初平均基金份额净值 0.9981

4.期末基金份额净值 750,736,781.70

5.期末基金净值 1.0581

注:本基金已实现收益指本基金本期已实现收入、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.本报告期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将有所下降。

3.2.7.2 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A

1.本期已实现收益 36,219,645.48

2.本期利润 41,217,321.39

3.期初平均基金份额净值 0.9981

4.期末基金份额净值 750,736,781.70

5.期末基金净值 1.0581

注:本基金已实现收益指本基金本期已实现收入、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.本报告期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将有所下降。

3.2.8.2 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

单位:人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

中金纯债A

1.本期已实现收益 36,219,645.48

2.本期利润 41,217,321.39

3.期初平均基金份额净值 0.9981

4.期末基金份额净值 750,736,781.70

5.期末基金净值 1.0581

注:本基金已实现收益指本基金本期已实现收入、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。</