

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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:二〇一五年七月二十日

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:中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2015年7月17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。

本报告期中财务资料未经审计。

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

基金简称	新华纯债添利债券型发起式证券投资基金
基金代码	610162
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
报告期末基金份额总额	976,320,200.03份

基金目标

本基金通过投资组合的久期、期限的品种、类属品种进行配置以及时择机操作,提高基金资产的流动性及收益率水平,为投资者提供风险较低的回报。

投资策略

本基金的投资策略主要包含:利率期限策略、类属品种配置策略以及择时操作策略,通过分析利率、信用利差、信用品种的定价水平以及不同信用品种的定价价值,积极运用久期策略、类属品种配置策略以及择时操作策略,在控制风险的前提下,提高投资组合的流动性。

业绩比较基准

中债综合指数(全价)。

风险特征

本基金为债券型基金,其平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金。

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

下属两级基金的基金简称

新华纯债添利债券型发起式C类

下属两级基金的交易代码

610162 610163

报告期末下属两级基金的份额总额

620,462,701.89份 364,667,506.05份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币

报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)

主要财务指标

新华纯债添利债券型发起式C类

1.本期已实现收益 16,967,497.23元 3,467,920.40元

2.本期利润 16,363,310.01元 3,618,210.04元

3.加权平均基金份额本期利润 0.02165 0.0164

4.期末基金资产净值 773,387,000.30元 437,431,202.12元

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)扣除除大额申购后的余额,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.以上所列各项金额比例不包括持有人认购交易基金的各项费用(例如基金申购赎回费等),计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

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.新华纯债添利债券型A类:

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.80% 0.04% 1.37% 0.09% 0.43% -0.06%

2.新华纯债添利债券型C类:

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.57% 0.06% 1.37% 0.08% 0.20% -0.04%

3.2.2 基金合同生效以来基金份额净值增长率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同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2012年12月21日至2015年6月30日)

1.新华纯债添利债券型A类:

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

新华纯债添利债券型C类:

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

新华纯债添利债券型发起式