

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
送出日期:2015年8月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月25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。

本报告书中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中金纯债债券型证券投资基金
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
基金合同生效日	2014年11月4日
基金类型	债券型基金
基金代码	14002244
基金简称	中金纯债
基金运作周期	不定期
基金存续期间	中金纯债
基金资产净值	100,000,000.00
基金总资产	126,380,196.02
基金总负债	23,306,490.32

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过稳健的投资原则，维持组合中等久期和杠杆，以中高等级信用债为主，为组合获取稳定回报。
投资策略	本基金将通过稳健的投资原则，维持组合中等久期和杠杆，以中高等级信用债为主，为组合获取稳定回报。
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
基金运作周期	不定期
基金存续期间	中金纯债
基金资产净值	100,000,000.00
基金总资产	126,380,196.02
基金总负债	23,306,490.32

2.3 基金管理人和基金托管人

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
名称	中金基金管理有限公司	名称	中国建设银行股份有限公司
住所	北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心南楼15层	住所	北京市西城区金融大街25号
法定代表人	孙志晨	法定代表人	田国立
信息披露负责人	孙志晨	信息披露负责人	田国立
电子邮箱	14002244@zjifund.com	电子邮箱	14002244@zjifund.com
客户服务电话	1000-800-9999	客户服务电话	1000-800-9999
传真	1000-800-9999	传真	1000-800-9999

2.4 信息披露方式

登载在中国证监会指定的合法网站的基金年度报告	http://www.zjifund.com
登载在基金托管人网站的基金年度报告	http://www.ccb.com

§ 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

项目	份额净值增长(%)	份额净值增长收益率(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率调整(%)	①-③	②-④
过去一个月	-0.10%	0.11%	0.45%	0.04%	-0.01%	0.00%
过去3个月	2.00%	0.12%	2.21%	0.09%	-0.10%	0.03%
过去6个月	2.00%	0.12%	3.17%	0.09%	-0.02%	0.03%
过去1年	4.10%	0.11%	4.01%	0.12%	-0.01%	-0.01%

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、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字;

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。

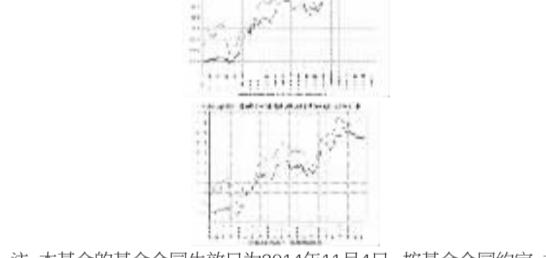
3.2 基金净值表现

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
中金纯债A

阶段	份额净值增长(%)	份额净值增长收益率(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率调整(%)	①-③	②-④
过去一个月	-0.10%	0.11%	0.45%	0.04%	-0.01%	0.00%
过去3个月	2.00%	0.12%	2.21%	0.09%	-0.10%	0.03%
过去6个月	2.00%	0.12%	3.17%	0.09%	-0.02%	0.03%
过去1年	4.10%	0.11%	4.01%	0.12%	-0.01%	-0.01%

注: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动的比较



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有关约定。

§ 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

中金基金管理有限公司(简称“中金公司”)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家公募基金管理公司,也是首家通过发起设立方式由单一股东控股的基金公司,注册资本1.5亿元人民币。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朝阳区建国门外大街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。公司目前拥有共同基金募集和管理资格,特定客户资产管理业务资格。

截至2015年6月30日,公司旗下管理4支开放式基金—中金现金管家货币市场基金、中金纯债债券型证券投资基金、中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金和中金消费升级分级股票型证券投资基金,证券投资基金管理规模30.21亿元。

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(时间)	证券从业年限	性别
石云鹤	本基金的基金经理	2014年11月4日	-	男

注:1、任职日期说明:任职日期为基金合同生效日

2、证券从业人员的计算标准:证券从业人员遵从行业协会《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合规性情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金销售行为指引》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,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,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合,严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,规范投资、研究和交易等各相关流程,通过系统控制和人工监控等方式在各环节严控,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

本报告期内,本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

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。

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

上半年,国内经济依然面临较大的下行压力,货币政策对实体经济的传导较慢,宏观经济数据持续低于预期。不过,二季度宏观经济状况显示出现企稳态势。工业增加值同比增速在3月份下滑至6.5%,达到2008年以来最低,4月和5月则温和回升至5.9%和6.1%。通胀数据维持低位,其中CPI同比数据较去年同期大幅下降,PPI继续保持在-4%以下的水平,工业通缩趋势明显。

上半年货币总量总体延续适度宽松的基调,人民银行启动了包括下调存款利率、重启逆回购并下调公开市场回购利率、降低存款准备金率、续作中短期借贷便利等多种工具,积极引导利率水平下行。

固定收益市场资金分流效应明显,且地方债置换不断影响市场情绪,报告期内债券市场收益率震荡下行。其中,利率债以震荡为主,高等级信用债收益率整体下行,而低等级信用债收益率则维持在相对高位。

报告期内,本基金的债券投资策略和业绩表现的说明

本基金管理人依据中国证券监督管理委员会《关于准予中金纯债债券型证券投资基金基金合同的批复》(证监许可[2014]869号)以及《关于准予中金纯债债券型证券投资基金基金合同的批复》(证监许可[2014]870号)的有关规定,依照基金合同的约定,负责本基金的日常运作。

本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。

本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。

本报告书中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日至2015年6月30日止。

§ 5 基金份额净值

本报告期基金份额净值

</div