

## 中金纯债债券型证券投资基金

## [2015] 年 度 报 告 摘 要

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：2016年3月25日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、董事会、监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。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由监事会签发。

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数据、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。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	中金纯债
基金主代码	000001
交易方式	货币市场型
基金运作周期	无固定运作周期
基金经理	杜季柳
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
报告期基金份额总额	147,362,372,175份
报告期末基金份额总额	147,362,372,175份

投资目标	在有效控制风险和保持流动性的基础上，通过合理的投资策略，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金对宏观经济和经济状况、货币政策、利率走势、证券市场变化等进行综合分析，结合对不同行业、不同投资品种的预期，优化资产配置，力求在保证本金安全的前提下，实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证综合债指数
风险收益特征	该基金为债券型基金，收益风险低于股票型基金，高于货币市场基金。
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，通过合理的投资策略，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金对宏观经济和经济状况、货币政策、利率走势、证券市场变化等进行综合分析，结合对不同行业、不同投资品种的预期，优化资产配置，力求在保证本金安全的前提下，实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证综合债指数
风险收益特征	该基金为债券型基金，收益风险低于股票型基金，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	中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
姓名	杜季柳	田雷
信息披露负责人	010-62361222	010-62361200
电子邮箱	xiugeliu@zcfund.com	tianlei@ccb.com
客户服务电话	010-8200-1166	010-52990000
传真	010-65019221	010-65270503

2.4 信息披露方式	基金管理人在法定的信息披露网站（http://www.zcfund.com/）及基金托管人在中国建设银行网站（http://www.ccb.com/）上披露。
2.5 主要数据报告、基金净值表现及利润分配情况	

金额单位：人民币元						
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	2,894,031.80					
本期利润	4,900,136.07					
加权平均基金份额净值	931,274.06					
本期末基金份额净值	931,274.06					
本期份额变动	-6,027,712.00					
期末可供分配利润	3,101,171.03					
本期利润	6,027,712.00					
加权平均基金份额变动率	0.07%					
期末可供分配利润	0.0007					
期末可供分配利润	0.0007					
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.本报告例示的基金业绩指标不包括任何认申购或赎回费用，计入费用后实际收益水平将低于数字；						
3.期末可供分配利润即期末可供分配的利润减去现金分红部分；						
4.本基金合同于2014年11月4日生效，合同生效当期的各项数据按实际存续期计算。						
5.2 基金净值表现						
5.2.1 基金的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	①近一月	②近三月	③近六月	④近九月	⑤近一年	⑥近一季
过去一个月	2.00%	0.00%	2.70%	0.07%	-0.06%	0.01%
过去三个月	4.51%	0.07%	5.39%	0.07%	-0.08%	0.00%
过去一年	7.62%	0.10%	8.74%	0.08%	-1.12%	0.02%
自基金合同成立以来	8.80%	0.10%	10.26%	0.10%	-1.40%	0.00%
中金纯债C						
阶段	①近一月	②近三月	③近六月	④近九月	⑤近一年	⑥近一季
过去一个月	7.62%	1.13%	11.08%	1.00%	1.00%	1.00%
过去三个月	12.22%	2.30%	12.30%	1.00%	1.00%	1.00%
过去一年	13.76%	10.13%	46,693,039.00	560,259,560.03	151,297,403.00	100,000.00
自基金合同成立以来	10.08%	1.05%	10.01%	1.01%	1.01%	1.01%
注：1.本基金的业绩比较基准为：中金纯债指数。						
3.2.2 自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的比较						
中金纯债A						
阶段	①近一月	②近三月	③近六月	④近九月	⑤近一年	⑥近一季
过去一个月	2.00%	0.00%	2.70%	0.07%	-0.06%	0.01%
过去三个月	4.51%	0.07%	5.39%	0.07%	-0.08%	0.00%
过去一年	7.62%	0.10%	8.74%	0.08%	-1.12%	0.02%
自基金合同成立以来	8.80%	0.10%	10.26%	0.10%	-1.40%	0.00%
中金纯债C						
阶段	①近一月	②近三月	③近六月	④近九月	⑤近一年	⑥近一季
过去一个月	7.62%	1.13%	11.08%	1.00%	1.00%	1.00%
过去三个月	12.22%	2.30%	12.30%	1.00%	1.00%	1.00%
过去一年	13.76%	10.13%	46,693,039.00	560,259,560.03	151,297,403.00	100,000.00
自基金合同成立以来	10.08%	1.05%	10.01%	1.01%	1.01%	1.01%
注：1.本基金的业绩比较基准为：中金纯债指数。						
3.2.2 自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的比较						
中金纯债A						
阶段	①近一月	②近三月	③近六月	④近九月	⑤近一年	⑥近一季
过去一个月	2.00%	0.00%	2.70%	0.07%	-0.06%	0.01%
过去三个月	4.51%	0.07%	5.39%	0.07%	-0.08%	0.00%
过去一年	7.62%	0.10%	8.74%	0.08%	-1.12%	0.02%
自基金合同成立以来	8.80%	0.10%	10.26%	0.10%	-1.40%	0.00%
中金纯债C						
阶段	①近一月	②近三月	③近六月	④近九月	⑤近一年	⑥近一季
过去一个月	7.62%	1.13%	11.08%	1.00%	1.00%	1.00%
过去三个月	12.22%	2.30%	12.30%	1.00%	1.00%	1.00%
过去一年	13.76%	10.13%	46,693,039.00	560,259,560.03	151,297,403.00	100,000.00
自基金合同成立以来	10.08%	1.05%	10.01%	1.01%	1.01%	1.01%
注：1.本基金的业绩比较基准为：中金纯债指数。						
3.2.3 自基金合同生效以来基金的年均净值增长率						
中金纯债A						
阶段	①近一月	②近三月	③近六月	④近九月	⑤近一年	⑥近一季
过去一个月	2.00%	0.00%	2.70%	0.07%	-0.06%	0.01%
过去三个月	4.51%	0.07%	5.39%	0.07%	-0.08%	0.00%
过去一年	7.62%	0.10%	8.74%	0.08%	-1.12%	0.02%
自基金合同成立以来	8.80%	0.10%	10.26%	0.10%	-1.40%	0.00%
中金纯债C						
阶段	①近一月	②近三月	③近六月	④近九月	⑤近一年	⑥近一季
过去一个月	7.62%	1.13%	11.08%	1.00%	1.00%	1.00%
过去三个月	12.22%	2.30%	12.30%	1.00%	1.00%	1.00%
过去一年	13.76%	10.13%	46,693,039.00	560,259,560.03	151,297,403.00	100,000.00
自基金合同成立以来	10.08%	1.05%	10.01%	1.01%	1.01%	1.01%
注：1.本基金的业绩比较基准为：中金纯债指数。						
3.3 过去三年基金的利润分配情况						
基金管理人根据法律法规及基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，自成立以来本基金未进行权益分配。						
4. 管理人报告						
4.1 基金管理人基本情况						
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”）作为全民股东，是证监会批准设立的第90家公募基金管理公司，也是首家通过发起式方式由单一股东控股的公募基金公司，注册资本人民币1亿元人民币。母公司中金公司曾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楼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。						
截至2015年12月31日，公司旗下共管理4只开放式基金——中金现金管理货币基金、中金纯债债券型基金、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股票型基金。						
4.2 基金经理（基金经理助理）及基金经理助理简介						
姓名	职务	任本基金的基金经理/助理/期间	证券从业年限	说明		
王云峰先生，经济学硕士，历任中国银河证券研究所研究员，平安证券研究员，太平洋资产管理有限公司研究员，中金基金管理有限公司研究员，现任中金基金管理有限公司研究员、基金经理。	基金经理	2014年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2015年12月31日			
石云峰	本基金的基金经理	2014年11月4日	9			
注：1.任职日期为：任职日期为基金合同生效日；						
2.证券从业人员因离职、退休等原因不能继续履行职责时，由接替人员接任，接任人员需具备证券从业资格；						
3.基金管理人对基金的管理情况						
本基金报告期内，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》、《证券投资基金销售适用性指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动的规定》及其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的情形。						
4.2.1 从业人员行为规范						
基金管理人和从业人员将遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售适用性指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动的规定》及其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的情形。						
4.2.2 从业人员行为规范						
基金管理人和从业人员将遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售适用性指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动的规定》及其他法律法规						