

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

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

尽的治理原则和运用基金资产,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 管理人报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度执行情况
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、债券的一般市场申购,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,投资指令由一级交易员下达,并且由交易系统公平交易模块,根据公平制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手交易,严格执行不同投资组合之间的双向交易。
场外交易,对于部分债券一般申购,非公开发行股票申购等业务,交易参照投资组合经理共同确定的符合条件的数量按比例分配,如存在,由交易部根据投资总监、督察长、基金经理和交易部审核,再次进行审核并确定最终分配方案,如果审核认为有必要,可以召开风险管理委员会,对公平交易的结果进行评估,对公平交易的结果进行审核,固定分配方案,交易所大宗交易,投资组合经理对该投资组合的公平交易的结果进行评估,交易部审核申购市场或交易对手的情况,达成一致,并报备“同向交易,价格优先”原则审核投资组合取得公平交易的机会。

4.3.2 异常交易监控执行情况
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。
基金管理人对于所有投资组合连续四个季度的日内、3日内和跨市场等交易同向交易价差分析及相关情况对比分析,未发现异常交易行为。
报告期内交易价差分析中异常交易的因素主要是受到市场异常波动或个股当日价格大幅波动或交易对手流动性不足,造成成交价格日波动较大以及投资组合的交叉同向交易导致个别组合的持仓比例高于其他组合,持仓集中度较高的原因,其次为卖出收益率以及利益追求金额等不同组合不同时段同向交易交易分析中投资组合之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内反向交易的行为,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且涉及少量交易成交事项且成交金额较大的情况。

4.4 管理人报告期内基金投资运作业绩表现的情况
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2015上半年债市主要呈现区间震荡走势,一方面经济数据数据显示经济下行压力仍大,货币政策不断发力,资金利率明显下行,推动债市长期资金需求出现阶段性下行;另一方面,随着上半年地方债发行节奏趋缓,股市快速上涨,10年期国债发行,债市资金回流,长期利率有所回落,中期票据、公司债、资产证券化等品种,经济数据持续低迷,市场风险增加,实际经济数据偏弱,长期利率有所回落,大量资金的需求未得到满足,推动债市长期收益率下行,至年末,10年期国债收益率下降28.62个基点,10年期国债收益率下降3.63个百分点,在操作上,虽然整体偏谨慎,操作上,但由于收益率水平吸引有限,本基金在操作上没有过于主动进攻,而是维持了较稳健的比操作风格,主要保持了组合的流动性配置的策略。

4.4.2 报告期内基金的投资组合报告
截至2015年12月31日,本基金A类份额净值为1.272元,本报告期份额净增长率为5.82%,同期比较基准的增长率为4.23%;本基金B类份额净值为1.28元,本报告期份额净增长率为5.4%,同期比较基准的增长率为4.2%。

4.5 管理人宏观经济、证券市场及行业走势的主要判断
未来一段时期,在经济增速放缓和通胀中枢下移以及大量的资产配置要求决定了利率基本走势,财政政策在托底作用、美国加息预期下,资金回流国内,通胀中枢下移,利率有所回落,中期票据、公司债、资产证券化等品种,经济数据持续低迷,市场风险增加,实际经济数据偏弱,长期利率有所回落,大量资金的需求未得到满足,推动债市长期收益率下行,至年末,10年期国债收益率下降28.62个基点,10年期国债收益率下降3.63个百分点,在操作上,虽然整体偏谨慎,操作上,但由于收益率水平吸引有限,本基金在操作上没有过于主动进攻,而是维持了较稳健的比操作风格,主要保持了组合的流动性配置的策略。

4.6 管理人报告期内基金投资运作事项的说明
4.6.1 估值程序
4.6.1.1 估值程序
4.6.1.2 估值程序
4.6.1.3 估值程序

4.6.2 估值程序
4.6.2.1 估值程序
4.6.2.2 估值程序

4.6.3 估值程序
4.6.3.1 估值程序
4.6.3.2 估值程序

4.6.4 估值程序
4.6.4.1 估值程序
4.6.4.2 估值程序

4.6.5 估值程序
4.6.5.1 估值程序
4.6.5.2 估值程序

4.6.6 估值程序
4.6.6.1 估值程序
4.6.6.2 估值程序

4.6.7 估值程序
4.6.7.1 估值程序
4.6.7.2 估值程序

4.6.8 估值程序
4.6.8.1 估值程序
4.6.8.2 估值程序

4.6.9 估值程序
4.6.9.1 估值程序
4.6.9.2 估值程序

4.6.10 估值程序
4.6.10.1 估值程序
4.6.10.2 估值程序

4.6.11 估值程序
4.6.11.1 估值程序
4.6.11.2 估值程序

4.6.12 估值程序
4.6.12.1 估值程序
4.6.12.2 估值程序

4.6.13 估值程序
4.6.13.1 估值程序
4.6.13.2 估值程序

4.6.14 估值程序
4.6.14.1 估值程序
4.6.14.2 估值程序

4.6.15 估值程序
4.6.15.1 估值程序
4.6.15.2 估值程序

4.6.16 估值程序
4.6.16.1 估值程序
4.6.16.2 估值程序

4.6.17 估值程序
4.6.17.1 估值程序
4.6.17.2 估值程序

4.6.18 估值程序
4.6.18.1 估值程序
4.6.18.2 估值程序

4.6.19 估值程序
4.6.19.1 估值程序
4.6.19.2 估值程序

4.6.20 估值程序
4.6.20.1 估值程序
4.6.20.2 估值程序

4.6.21 估值程序
4.6.21.1 估值程序
4.6.21.2 估值程序

4.6.22 估值程序
4.6.22.1 估值程序
4.6.22.2 估值程序

4.6.23 估值程序
4.6.23.1 估值程序
4.6.23.2 估值程序

4.6.24 估值程序
4.6.24.1 估值程序
4.6.24.2 估值程序

4.6.25 估值程序
4.6.25.1 估值程序
4.6.25.2 估值程序

4.6.26 估值程序
4.6.26.1 估值程序
4.6.26.2 估值程序

4.6.27 估值程序
4.6.27.1 估值程序
4.6.27.2 估值程序

4.6.28 估值程序
4.6.28.1 估值程序
4.6.28.2 估值程序

4.6.29 估值程序
4.6.29.1 估值程序
4.6.29.2 估值程序

4.6.30 估值程序
4.6.30.1 估值程序
4.6.30.2 估值程序

4.6.31 估值程序
4.6.31.1 估值程序
4.6.31.2 估值程序

4.6.32 估值程序
4.6.32.1 估值程序
4.6.32.2 估值程序

4.6.33 估值程序
4.6.33.1 估值程序
4.6.33.2 估值程序

4.6.34 估值程序
4.6.34.1 估值程序
4.6.34.2 估值程序

4.6.35 估值程序
4.6.35.1 估值程序
4.6.35.2 估值程序

4.6.36 估值程序
4.6.36.1 估值程序
4.6.36.2 估值程序

4.6.37 估值程序
4.6.37.1 估值程序
4.6.37.2 估值程序

4.6.38 估值程序
4.6.38.1 估值程序
4.6.38.2 估值程序

4.6.39 估值程序
4.6.39.1 估值程序
4.6.39.2 估值程序

4.6.40 估值程序
4.6.40.1 估值程序
4.6.40.2 估值程序

4.6.41 估值程序
4.6.41.1 估值程序
4.6.41.2 估值程序

4.6.42 估值程序
4.6.42.1 估值程序
4.6.42.2 估值程序

4.6.43 估值程序
4.6.43.1 估值程序
4.6.43.2 估值程序

4.6.44 估值程序
4.6.44.1 估值程序
4.6.44.2 估值程序

4.6.45 估值程序
4.6.45.1 估值程序
4.6.45.2 估值程序

4.6.46 估值程序
4.6.46.1 估值程序
4.6.46.2 估值程序

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

Table with 3 columns: Item, 2015年1月1日至2015年12月31日, 2014年1月1日至2014年12月31日. Rows include 本期基金份额净值增长率, 上期基金份额净值增长率, etc.

本基金本报告期末未有银行间市场债券正回购。
7.4.9.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末未有交易所市场债券正回购。

8.1 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 投资组合, 金额, 占基金资产净值比例(%)

8.2 期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.4 按行业配置的股票投资组合中的重大变动
8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或20名的股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或20名的股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入
本基金本报告期末未持有股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 债券名称, 数量(万), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资的股指期货的投资收益
本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
8.11.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 投资国债期货的投资收益
本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资衍生品
8.12.1 投资衍生品
8.12.2 投资衍生品

8.12.3 投资衍生品
8.12.4 投资衍生品

8.12.5 投资衍生品
8.12.6 投资衍生品

8.12.7 投资衍生品
8.12.8 投资衍生品

8.12.9 投资衍生品
8.12.10 投资衍生品

8.12.11 投资衍生品
8.12.12 投资衍生品

8.12.13 投资衍生品
8.12.14 投资衍生品

8.12.15 投资衍生品
8.12.16 投资衍生品

8.12.17 投资衍生品
8.12.18 投资衍生品

8.12.19 投资衍生品
8.12.20 投资衍生品

8.12.21 投资衍生品
8.12.22 投资衍生品

8.12.23 投资衍生品
8.12.24 投资衍生品

8.12.25 投资衍生品
8.12.26 投资衍生品

8.12.27 投资衍生品
8.12.28 投资衍生品

</