

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

基金管理人:新华基金管理股份有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示:基金管理人、基金托管人及基金销售机构均承诺不以虚假记载、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法律责任。

基金管理人新华基金管理股份有限公司根据基金合同约定,于2017年4月18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。

基金的投资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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

基金概况:新华纯债添利债券发起式基金,基金代码:519152,基金运作方式:契约型开放式基金。

投资目标:本基金通过投资于债券资产,力争在严格控制投资风险的前提下,提高基金资产的流动性及收益水平,为投资者提供长期稳定的投资回报。

投资策略:本基金的投资策略包括:利率预期策略、类属配置策略以及证券选择策略。采用定量与定性相结合的研究方法,深入分析市场利率变化方向、期限结构和流动性状况,合理配置久期及信用等级的投资资产。

基金管理人:新华基金管理股份有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标和基金净值表现:3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2017年1月1日至2017年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期净利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值.

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。

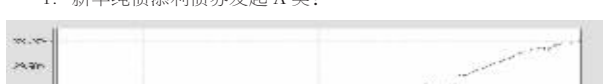
3.2 基金净值表现:3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④. Rows for 过去三个月 and 过去六个月.

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的比较

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2012年12月21日至2017年3月31日)

1. 新华纯债添利债券发起 A 类:



2. 新华纯债添利债券发起 C 类:



注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

4 管理人报告:4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers and their backgrounds.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理股份有限公司作为新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的基金管理人,严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明:4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面判断不同投资组合之间在某一段时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,工业企业利润增速提高,带动经济基本面短期企稳;CPI和PPI冲高回落,通胀预期逐步降温,但工业品价格仍处在高位可能带动企业补库存和增加投资;货币政策逐步收紧,但利率仍维持在低位。

利率债市场上,收益率波动上行,短端涨幅约30bp,长期的10年期国债上行18bp至3.28%,10年期国债上行36bp至4.06%,期限利差持续维持在较低水平。

4.4.2 报告期内基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

投资目标:综合运用多种投资策略,在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,力争为投资者提供长期稳定的投资回报。

投资策略:本基金的投资策略包括:利率预期策略、类属配置策略以及证券选择策略。

风险收益特征:本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币型基金。

基金管理人:新华基金管理股份有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标和基金净值表现:3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2017年1月1日至2017年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期净利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值.

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。

3.2 基金净值表现:3.2.1 本报告期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

Table with 6 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④. Rows for 过去三个月 and 过去六个月.

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的比较

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2012年12月21日至2017年3月31日)

1. 新华纯债添利债券发起 A 类:



2. 新华纯债添利债券发起 C 类:



注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

4 管理人报告:4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers and their backgrounds.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理股份有限公司作为新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的基金管理人,严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明:4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面判断不同投资组合之间在某一段时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,工业企业利润增速提高,带动经济基本面短期企稳;CPI和PPI冲高回落,通胀预期逐步降温,但工业品价格仍处在高位可能带动企业补库存和增加投资;货币政策逐步收紧,但利率仍维持在低位。

利率债市场上,收益率波动上行,短端涨幅约30bp,长期的10年期国债上行18bp至3.28%,10年期国债上行36bp至4.06%,期限利差持续维持在较低水平。

4.4.2 报告期内基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

投资目标:综合运用多种投资策略,在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,力争为投资者提供长期稳定的投资回报。

投资策略:本基金的投资策略包括:利率预期策略、类属配置策略以及证券选择策略。

风险收益特征:本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币型基金。

基金管理人:新华基金管理股份有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标和基金净值表现:3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2017年1月1日至2017年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期净利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值.

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。

3.2 基金净值表现:3.2.1 本报告期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

Table with 6 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④. Rows for 过去三个月 and 过去六个月.

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的比较

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2012年12月21日至2017年3月31日)

1. 新华纯债添利债券发起 A 类:



2. 新华纯债添利债券发起 C 类:



注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

4 管理人报告:4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers and their backgrounds.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理股份有限公司作为新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的基金管理人,严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明:4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面判断不同投资组合之间在某一段时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,工业企业利润增速提高,带动经济基本面短期企稳;CPI和PPI冲高回落,通胀预期逐步降温,但工业品价格仍处在高位可能带动企业补库存和增加投资;货币政策逐步收紧,但利率仍维持在低位。

利率债市场上,收益率波动上行,短端涨幅约30bp,长期的10年期国债上行18bp至3.28%,10年期国债上行36bp至4.06%,期限利差持续维持在较低水平。

4.4.2 报告期内基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

投资目标:综合运用多种投资策略,在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,力争为投资者提供长期稳定的投资回报。

投资策略:本基金的投资策略包括:利率预期策略、类属配置策略以及证券选择策略。

风险收益特征:本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币型基金。

基金管理人:新华基金管理股份有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标和基金净值表现:3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2017年1月1日至2017年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期净利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值.

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。

3.2 基金净值表现:3.2.1 本报告期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

Table with 6 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④. Rows for 过去三个月 and 过去六个月.

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的比较

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2012年12月21日至2017年3月31日)

1. 新华纯债添利债券发起 A 类:



2. 新华纯债添利债券发起 C 类:



注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

4 管理人报告:4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers and their backgrounds.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理股份有限公司作为新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的基金管理人,严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明:4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面判断不同投资组合之间在某一段时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,工业企业利润增速提高,带动经济基本面短期企稳;CPI和PPI冲高回落,通胀预期逐步降温,但工业品价格仍处在高位可能带动企业补库存和增加投资;货币政策逐步收紧,但利率仍维持在低位。

利率债市场上,收益率波动上行,短端涨幅约30bp,长期的10年期国债上行18bp至3.28%,10年期国债上行36bp至4.06%,期限利差持续维持在较低水平。

4.4.2 报告期内基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

投资目标:综合运用多种投资策略,在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,力争为投资者提供长期稳定的投资回报。

投资策略:本基金的投资策略包括:利率预期策略、类属配置策略以及证券选择策略。

风险收益特征:本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币型基金。

基金管理人:新华基金管理股份有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标和基金净值表现:3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2017年1月1日至2017年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期净利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值.

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。

3.2 基金净值表现:3.2.1 本报告期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

Table with 6 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④. Rows for 过去三个月 and 过去六个月.

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的比较

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2012年12月21日至2017年3月31日)

1. 新华纯债添利债券发起 A 类:



2. 新华纯债添利债券发起 C 类:



注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

4 管理人报告:4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers and their backgrounds.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理股份有限公司作为新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的基金管理人,严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明:4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面判断不同投资组合之间在某一段时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,工业企业利润增速提高,带动经济基本面短期企稳;CPI和PPI冲高回落,通胀预期逐步降温,但工业品价格仍处在高位可能带动企业补库存和增加投资;货币政策逐步收紧,但利率仍维持在低位。

利率债市场上,收益率波动上行,短端涨幅约30bp,长期的10年期国债上行18bp至3.28%,10年期国债上行36bp至4.06%,期限利差持续维持在较低水平。

4.4.2 报告期内基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

投资目标:综合运用多种投资策略,在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,力争为投资者提供长期稳定的投资回报。

投资策略:本基金的投资策略包括:利率预期策略、类属配置策略以及证券选择策略。

风险收益特征:本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币型基金。

基金管理人:新华基金管理股份有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标和基金净值表现:3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2017年1月1日至2017年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期净利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金资产净值.

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。

3.2 基金净值表现:3.2.1 本报告期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

Table with 6 columns: 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, 业绩比较基准标准差④, ①-③, ②-④. Rows for 过去三个月 and 过去六个月.

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的比较

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图 (2012年12月21日至2017年3月31日)

1. 新华纯债添利债券发起 A 类:



2. 新华纯债添利债券发起 C 类:



注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

4 管理人报告:4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers and their backgrounds.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理股份有限公司作为新华纯债添利债券型发起式证券投资基金的基金管理人,严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明:4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面判断不同投资组合之间在某一段时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,工业企业利润增速提高,带动经济基本面短期企稳;CPI和PPI冲高回落,通胀预期逐步降温,但工业品价格仍处在高位可能带动企业补库存和增加投资;货币政策逐步收紧,但利率仍维持在低位