新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 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

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

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本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	新华纯债添利债券发起
基金主代码	519152
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 21 日
报告期末基金份额总额	197,494,011.07 份
投资目标	本基金通过对债券组合的久期、期限结构、类属品种以及单个债券进行积极主动的配置，力争在严格控制投资组合风险的同时，提高基金资产的流行性及收益率水平，为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：利率预期策略、类属品种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

	场利率发展方向、期限结构变化趋势、信用主体评级水平以及单个债券的投资价值，积极主动进行类属品种配置及个券选择，谋求基金资产的长期稳定增值。		
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率		
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，高于货币市场基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	新华纯债添利债券发起 A	新华纯债添利债券发起 C	新华纯债添利债券发起 B
下属分级基金的交易代码	519152	519153	009104
报告期末下属分级基金的份额总额	153,504,995.43 份	33,492,347.84 份	10,496,667.80 份

§3 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

主要财务指标	报告期 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)		
	新华纯债添利债券发起 A	新华纯债添利债券发起 C	新华纯债添利债券发起 B
1.本期已实现收益	1,096,285.10	191,756.71	61,557.63
2.本期利润	1,404,705.89	257,460.44	80,551.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0092	0.0078	0.0078
4.期末基金资产	189,565,733.55	40,483,999.06	11,730,280.65

净值			
5.期末基金份额净值	1.2349	1.2088	1.1175

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、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购费、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

1、新华纯债添利债券发起 A：

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	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.75%	0.02%	0.52%	0.03%	0.23%	-0.01%
过去六个月	1.74%	0.02%	1.15%	0.03%	0.59%	-0.01%
过去一年	3.03%	0.02%	1.48%	0.04%	1.55%	-0.02%
过去三年	8.16%	0.05%	5.66%	0.07%	2.50%	-0.02%
过去五年	12.92%	0.05%	8.15%	0.07%	4.77%	-0.02%
过去七年	19.71%	0.04%	10.36%	0.07%	9.35%	-0.03%
过去十年	34.84%	0.04%	9.88%	0.07%	24.96%	-0.03%
自基金合同生效起至今	77.86%	0.06%	18.64%	0.08%	59.22%	-0.02%

2、新华纯债添利债券发起 C：

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	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.65%	0.02%	0.52%	0.03%	0.13%	-0.01%
过去六个月	1.54%	0.02%	1.15%	0.03%	0.39%	-0.01%
过去一年	2.62%	0.02%	1.48%	0.04%	1.14%	-0.02%
过去三年	6.89%	0.05%	5.66%	0.07%	1.23%	-0.02%
过去五年	10.69%	0.05%	8.15%	0.07%	2.54%	-0.02%
过去七年	16.51%	0.04%	10.36%	0.07%	6.15%	-0.03%
过去十年	29.80%	0.04%	9.88%	0.07%	19.92%	-0.03%
自基金合同生效起至今	68.73%	0.06%	18.64%	0.08%	50.09%	-0.02%

3、新华纯债添利债券发起 B：

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	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.69%	0.02%	0.52%	0.03%	0.17%	-0.01%
过去六个月	1.64%	0.02%	1.15%	0.03%	0.49%	-0.01%
过去一年	2.82%	0.02%	1.48%	0.04%	1.34%	-0.02%
过去三年	7.52%	0.05%	5.66%	0.07%	1.86%	-0.02%
过去五年	11.80%	0.05%	8.15%	0.07%	3.65%	-0.02%
自基金合同生效起至今	16.00%	0.04%	7.96%	0.07%	8.04%	-0.03%

注：1、本基金自2020年3月4日起增加B类基金份额（基金代码：009104），份额首次确认日为2020年3月17日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2、本基金自2026年9月21日起业绩比较基准由“中债新综合指数(全价)”变更为“中债-综合全价（总值）指数收益率”。

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变动的比较

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 2026 年 9 月 30 日)

1．新华纯债添利债券发起 A：



2．新华纯债添利债券发起 C：



3．新华纯债添利债券发起 B：



注：1、本基金自 2020 年 3 月 4 日起增加 B 类基金份额（基金代码：009104），份额首次确认日为 2020 年 3 月 17 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2、本基金自 2026 年 9 月 21 日起业绩比较基准由“中债新综合指数(全价)”变更为“中债-综合全价（总值）指数收益率”。

§4 管理人报告

4.1基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晓然	本基金基金经理，新华鼎利债券型证券投资基金基金经理、新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、新华双利债券型证券投资基金基金经理。	2023-02-23	-	13	金融与投资硕士，曾任大公国际资信评估有限公司分析师、行业组长、经理，新华基金管理股份有限公司信用研究员、基金经理助理。

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2管理人对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管理人按照《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。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%情形。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，海外地缘政治冲突反复，但市场对其影响总体脱敏，美联储独立性和美国财政纪律的不确定性进一步推升美债利率，美联储加息落地。国内经济来看，出口保持韧性，房地产、基建和消费数据延续走弱，CPI 和 PPI 环比走弱，内外需景气度分化，居民房贷贴息和政策性金融工具结构性降息落地。债券市场来看，资金面平稳、内需偏弱和资产荒支撑三季度债券市场走强，长债利率水平突破前低。曲线形态来看，三季度债券收益率曲线中短端总体变化不大，长端及超长端呈现利差压缩行情。具体来看，1 年期国债收益率上行 10bp 至 1.22%，10 年期国债收益率下行 5bp 至 1.68%，30 年期国债收益率下行 14bp 至 2.10%，30-10 年期国债利差进一步收窄。

本报告期内，本基金提升组合久期，以票息和杠杆策略为主，适度参与了长债波段交易，以为投资者提供稳定回报为目标。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.2349 元，本报告期份额净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%；C 类基金份额净值为 1.2088 元，本报告期份额净值增长率为 0.65%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%；B 类基金份额净值为 1.1175 元，本报告期份额净值增长率为 0.69%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	287,756,691.74	95.19
	其中：债券	287,756,691.74	95.19
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,219,498.18	4.70
7	其他资产	308,565.63	0.10
8	合计	302,284,755.55	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 报告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。

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	66,479,604.39	27.50
	其中：政策性金融债	25,372,882.20	10.49
4	企业债券	4,724,031.45	1.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	216,553,055.90	89.57
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	287,756,691.74	119.02

5.5报告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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	232680008	26 渤海银行二级资本债 01	200,000	20,384,432.88	8.43
2	102480744	24 云能投 MTN005	100,000	10,619,609.32	4.39
3	102585026	25 新华水力 MTN004B	100,000	10,481,200.55	4.34
4	102580651	25 厦门海翼 MTN001B	100,000	10,457,341.92	4.33
5	102400650	24 首创集 MTN001B	100,000	10,438,385.75	4.32

5.6报告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。

5.7报告期末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。

5.8报告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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资范围不包含股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,737.22
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	306,828.41
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	308,565.63

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华纯债添利债券发起A	新华纯债添利债券发起C	新华纯债添利债券发起B
本报告期期初基金份额总额	152,694,165.98	32,851,052.79	10,629,524.94
报告期期间基金总申购份额	7,618,813.16	1,802,204.38	1,013,021.55
减：报告期期间基金总赎回份额	6,807,983.71	1,160,909.33	1,145,878.69
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-

本报告期期末基金份额总额	153,504,995.43	33,492,347.84	10,496,667.80

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立于2012年12月21日，发起份额于2018年8月27日赎回，满足发起份额承诺持有期。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未有影响投资者决策的其他重要信息。

§10 备查文件目录

10.1备查文件目录

（一）中国证监会准予新华纯债添利债券型发起式证券投资基金注册的文件

（二）《关于申请募集新华纯债添利债券型发起式证券投资基金之法律意见书》

（三）《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金托管协议》

（四）《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》

（五）《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金招募说明书》 （更新）

（六） 基金管理人业务资格批件、营业执照

（七） 基金托管人业务资格批件、营业执照

10.2存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

10.3查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新华基金管理股份有限公司

二〇二六年十月二十七日