

新华阿里一号保本混合型证券投资基金
2016 年年度报告摘要
2016 年 12 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月三十一日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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、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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务材料已经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华阿里一号保本混合
基金主代码	000610
交易代码	000610
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2014 年 4 月 25 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	800,533,464.36 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	综合运用投资组合保险策略,严格控制风险,在为投资人提供投资金额安全保证的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	在投资策略方面,本基金将主要采用恒定比例组合保本策略(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)CPPi 策略以数量化的分析模型为基础,主要通过动态地监控和调整基金在固定收益资产与风险资产上的投资比例,确保基金投资组合的风险暴露水平不超过基金可承担的损失限额(又称安全垫),以实现确保保本周期到期时本金安全目标。而主动承担股票投资风险,通过选择市场时机和精选个股进行投资,还可为基金实现资本增值。
业绩比较基准	(一年期银行定期存款税后收益率+1%)×1.5
风险收益特征	本基金为积极配置的保本混合型基金,属于证券投资基金当中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,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		新华基金管理股份有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	方琦
	联系电话	010-88423386	0755-22160168
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		4008198866	95511-3
传真		010-88423310	0755-82080387

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况**3.1 主要会计数据和财务指标**

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 4 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	77,898,048.67	221,022,662.22	78,226,102.38
本期利润	49,723,888.13	147,234,909.08	182,552,168.07
加权平均基金份额本期利润	0.0621	0.2433	0.3259
本期基金份额净值增长率	6.10%	19.96%	32.60%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.4401	0.3438	0.1397
期末基金资产净值	864,174,938.45	814,451,050.32	742,651,684.87
期末基金份额净值	1.079	1.017	1.326

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.22%	0.12%	0.94%	0.00%	0.28%	0.12%
过去六个月	3.55%	0.14%	1.89%	0.00%	1.66%	0.14%
过去一年	6.10%	0.15%	3.75%	0.00%	2.35%	0.15%
自基金合同生效起至今	68.76%	0.47%	12.51%	0.00%	56.25%	0.47%

注：1、本基金业绩比较基准采用(一年期银行定期存款税后收益率+1%)*1.5。

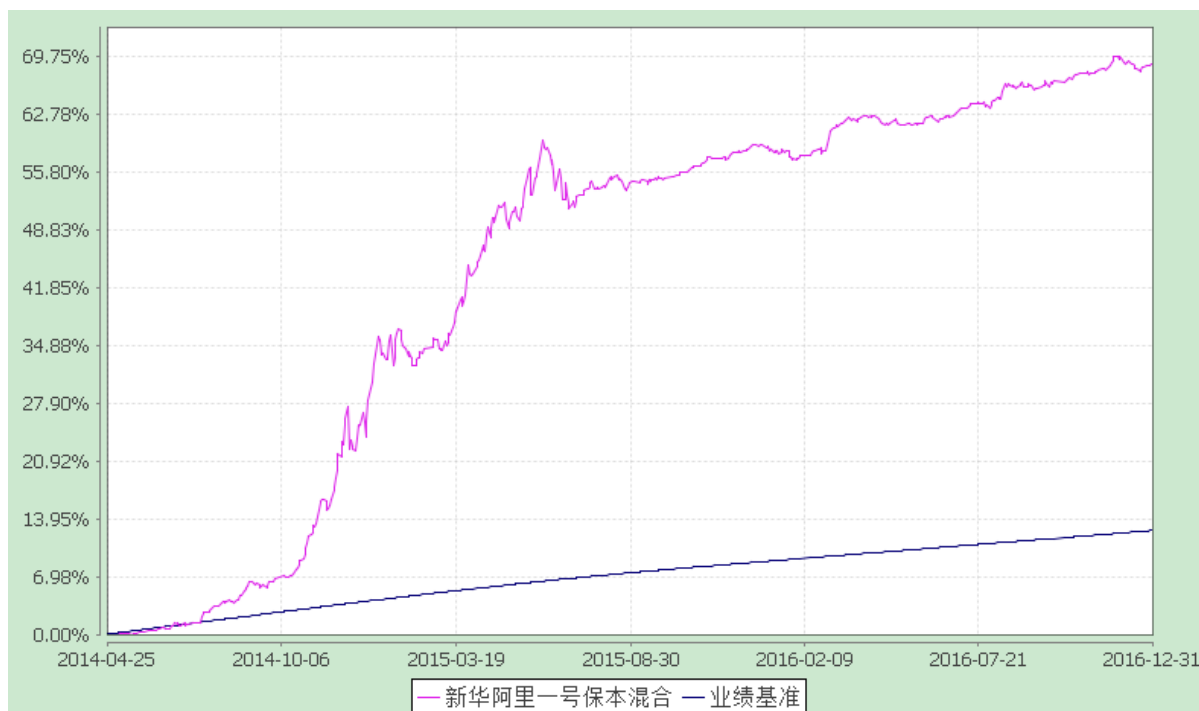
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华阿里一号保本混合型证券投资基金

份额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

(2014 年 4 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日)

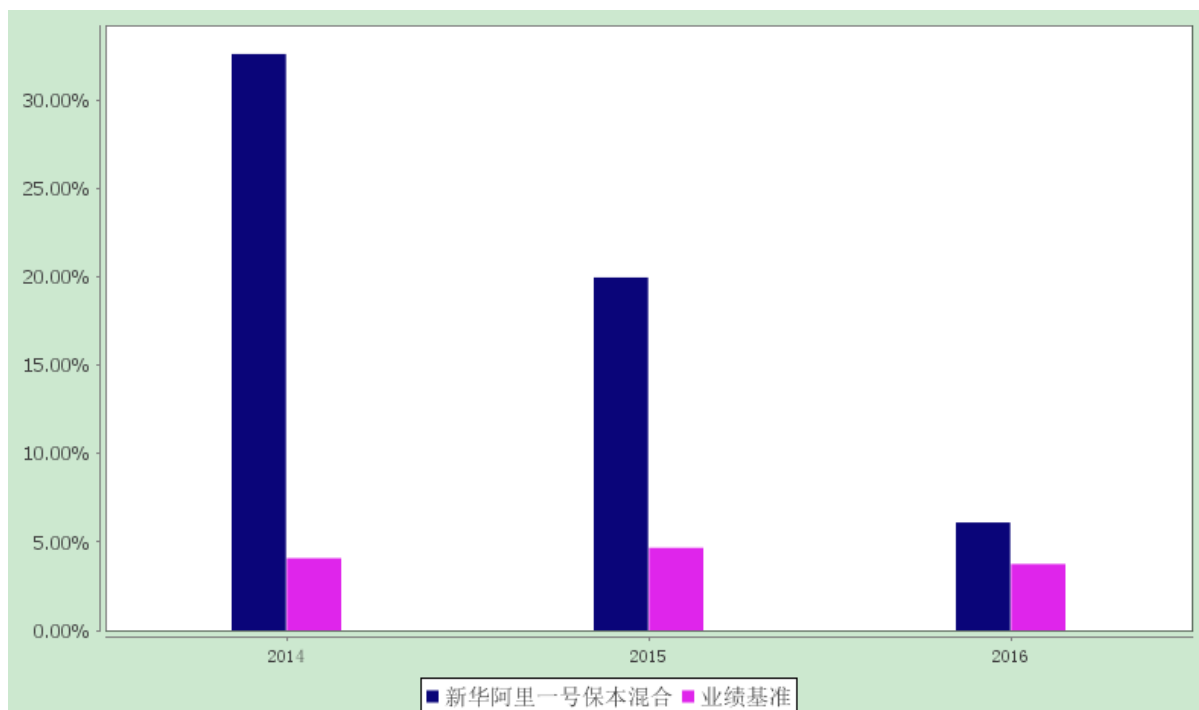


注：本基金于 2014 年 4 月 25 日基金合同生效。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华阿里一号保本混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金自 2014 年 4 月 25 日基金合同生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

§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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2016 年 12 月 31 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十一只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华信用增益债券型证券投资基金、新华惠鑫分级债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华阿里一号保本混合型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华信用增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫锐混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金和新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限	证券从业 年限	说明

		任职日期	离任日期		
姚秋	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司固定收益与平衡投资部总监、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理。	2014-07-18	-	7	经济学博士、注册金融分析师，历任中国建设银行北京分行投资银行部投资研究工作、中国工商银行资产管理部固定收益投资经理。2014 年 4 月加入新华基金管理股份有限公司。现任新华基金管理股份有限公司固定收益与平衡投资部总监、新华阿里一号保本混合型证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华阿里一号保本混合型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》、《新华阿里一号保本混合型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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、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，投资指令统一由交易部下达，并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度，严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中，对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易，交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议，由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定。

基金管理人旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明：债券同向交易频率偏低；股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断，即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大，结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合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反向交易行为的发生，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年，经济企稳迹象明显，上游产品价格止跌回升但波动剧烈，地产调控政策方向逐渐明晰，工业增速与通胀指标处于良性水平，汇率波动较大。货币政策边际收紧，对股市和债市均构成一定程度的负面影响，一季度股市熔断和四季度的国债期货跌停，使得股票指数和债券指数全年表现不佳。2016 年全年，我们都维持谨慎的股债投资策略。股票方面，我们适当调整了股票持仓结构，在不增加股票持仓的前提下，我们逢低适当增配了一些业绩优良且可持续性强或资产质量好的标的；债券方面，我们维持短久期高评级组合；转债方面，由于优质标的稀缺，我们没有参与二级市场投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日, 本基金份额净值为 1.079 元, 本报告期份额净值增长率为 6.10%, 同期比较基准的增长率为 3.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年, 经济增速有望维持在当前水平, 通胀中枢水平较 2016 年有抬高但不至于引发过多政策担忧, 金融降杠杆有可能会是今后一段时间的监管主基调。来自海外的不确定因素较多, 比较重要的有: 美国新总统能否通过基建、降税等手段提高美国经济增速; 美国加息步伐是否会超预期; 欧洲民粹主义会不会使欧盟局势进一步动荡; 以原油为代表的大宗商品价格会不会推升全球通胀。对于这些问题, 目前仍难给出确定的方向性答案, 为此, 我们会密切跟踪海外政治与经济态势, 并评估对国内经济与金融环境的影响。

股票方面: (1) 近期市场对基建投资带来的相关投资机会具有较高热情, 对此我们认为应保持适度谨慎。基建投资的可持续性并不强, 边际回报率在降低, 即使未来几年的业绩具有较强的确定性, 随后对业绩的预期也很难乐观。稳妥的股票投资应着眼于可持续业绩而不是几年的业绩。

(2) 与衣食住行和医疗相关的传统行业, 以及代表未来经济发展方向的蓝海领域, 虽然鱼龙混杂, 但仍值得多用时间与精力去发掘潜力标的。一方面, 经历了 2015 年下半年和 2016 年的股市调整, 一些好的标的估值已进入合理区间, 成长性也经历的时间的检验; 另一方面, 投资者群体中, 基本面派开始占优, 这也给价值成长型标的的脱颖而出提供了机会。展望未来一段时间, 新经济领域的概念与主题炒作很难再现 2015 年上半年的情景; 在旧经济领域, 库存周期导致的短期数据向好很难改变长期供给过剩、需求不足的格局。因此, 我们会立足于宏观经济与微观主体的基本面, 选择质地优良、估值合理的标的进行配置。

债券方面, 宏观环境的影响多空交织, 短期内, 工业增速、基建投资与通胀等指标对债券略偏利空, 叠加金融降杠杆政策, 对于长久期利率债, 我们仍不倾向于大比例配置, 但我们会密切跟踪各类影响因素的变化和收益率水平的变化。随着中短期收益率的抬升, 中短债的票息保护能力在增强, 这给防御型资金提供了较好的配置机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员 (或小组) 的职责分工

4.6.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

4.6.1.2 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

4.6.1.3 投资管理部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.6.1.4 交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；

- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

4.6.1.5 监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金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低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对新华阿里一号保本混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由新华基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

平安银行总行资产托管部

2017 年 3 月 27 日

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师 张伟 胡慰 签字出具了瑞华审字[2017]01360108 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华阿里一号保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	7,320,717.31	8,304,135.30
结算备付金	253,324.06	5,856,389.95
存出保证金	85,727.26	267,519.91
交易性金融资产	823,897,572.23	763,149,456.73
其中：股票投资	63,796,069.73	32,008,697.00
基金投资	-	-
债券投资	760,101,502.50	731,140,759.73
资产支持证券投资	-	-

贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	20,350,222.28	18,000,000.00
应收证券清算款	568,728.72	-
应收利息	13,146,558.13	20,964,851.38
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	865,622,849.99	816,542,353.27
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	718,261.71	1,131,300.73
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	219,517.71	206,668.23
应付托管费	73,172.57	68,889.38
应付销售服务费	73,172.57	68,889.38
应付交易费用	103,786.98	155,555.23
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	260,000.00	460,000.00
负债合计	1,447,911.54	2,091,302.95

所有者权益：	-	-
实收基金	511,836,212.41	511,836,212.41
未分配利润	352,338,726.04	302,614,837.91
所有者权益合计	864,174,938.45	814,451,050.32
负债和所有者权益总计	865,622,849.99	816,542,353.27

注：报告截至日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.079 元，基金份额总额 800,533,464.36 份。

7.2 利润表

会计主体：新华阿里一号保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	55,410,312.52	162,186,718.96
1.利息收入	29,834,803.16	62,727,783.60
其中：存款利息收入	156,100.36	337,569.30
债券利息收入	28,969,719.23	62,238,388.96
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	708,983.57	151,825.34
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	53,749,669.90	173,246,688.50
其中：股票投资收益	13,661,702.67	95,959,126.47
基金投资收益	-	-
债券投资收益	38,563,636.05	74,613,297.86
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,524,331.18	2,674,264.17

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-28,174,160.54	-73,787,753.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	5,686,424.39	14,951,809.88
1. 管理人报酬	2,512,926.85	2,452,952.02
2. 托管费	837,642.34	817,650.54
3. 销售服务费	837,642.34	817,650.54
4. 交易费用	413,389.52	979,223.25
5. 利息支出	582,148.34	9,387,634.94
其中：卖出回购金融资产支出	582,148.34	9,387,634.94
6. 其他费用	502,675.00	496,698.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	49,723,888.13	147,234,909.08
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	49,723,888.13	147,234,909.08

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华阿里一号保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	511,836,212.41	302,614,837.91	814,451,050.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,723,888.13	49,723,888.13
三、本期基金份额交易	-	-	-

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	511,836,212.41	352,338,726.04	864,174,938.45
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	560,099,516.80	182,552,168.07	742,651,684.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	147,234,909.08	147,234,909.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-48,263,304.39	-27,172,239.24	-75,435,543.63
其中：1.基金申购款	320,533,891.49	180,460,577.20	500,994,468.69
2.基金赎回款	-368,797,195.88	-207,632,816.44	-576,430,012.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益	511,836,212.41	302,614,837.91	814,451,050.32

(基金净值)			
--------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：陈重，主管会计工作负责人：张宗友，会计机构负责人：徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华阿里一号保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2014]334 号文件“关于同意新华阿里一号保本混合型证券投资基金募集的批复”批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于 2014 年 4 月 10 日至 4 月 23 日向社会公开募集，首次募集资金总额 560,099,516.80 元，募集资金产生利息 71,616.80 元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2014]第 37100016 号验资报告予以验证。2014 年 4 月 25 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式保本混合型证券投资基金，存续期不限定，申请发行基金募集份额不少于 2 亿份,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《新华阿里一号保本混合型证券投资基金招募说明书》及《新华阿里一号保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。本基金股票、权证等风险资产的投资比例不高于基金资产的 40%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;债券、货币市场工具等固定收益资产占基金资产的比例不低于 60%，在每个开放期间的前 3 个月、开放期间及开放期的后 3 个月不受前述投资组合比例的限制。在开放期，本基金持有现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，在保本期内（保本到期日除外），本基金不受该比例的限制。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2017 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 41 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布

的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华阿里一号保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

7.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税法征收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》的规定：2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自

2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定：对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时，对个人持股 1 年以内（含 1 年）的，上市公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
平安银行股份有限公司	基金托管人
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金托管人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
北京新华富时资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,512,926.85	2,452,952.02
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.3%/当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	837,642.34	817,650.54

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.1% 的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
新华基金管理股份有限公司	837,642.34	
合计	837,642.34	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
新华基金管理股份有限公司	817,650.54	
合计	817,650.54	

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	7,320,717.31	130,743.23	8,304,135.30	181,718.69

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	网下中签	15.28	15.28	681.00	10,405.68	10,405.68	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	网下中签	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	网下中签	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	网下中签	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	网下中签	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	网下中签	23.16	23.16	3,491.00	80,851.56	80,851.56	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	网下中签	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天燃气	2016-12-30	2017-01-10	网下中签	7.87	7.87	4,818.00	37,917.66	37,917.66	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	网下中签	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	网下中签	9.30	9.30	1,006.00	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	网下中签	3.07	3.07	2,396.00	7,355.72	7,355.72	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末持有暂时停牌流通受限的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末未有银行间市场债券正回购。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末持有交易所市场债券正回购。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	63,796,069.73	7.37
	其中：股票	63,796,069.73	7.37
2	固定收益投资	760,101,502.50	87.81
	其中：债券	760,101,502.50	87.81
	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	20,350,222.28	2.35
	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	7,574,041.37	0.87
7	其他各项资产	13,801,014.11	1.59
8	合计	865,622,849.99	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,787,000.00	0.44
C	制造业	5,817,096.17	0.67

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,986,515.00	0.35
J	金融业	3,568,780.00	0.41
K	房地产业	47,573,709.99	5.51
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	63,796,069.73	7.38

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601588	北辰实业	6,377,600	26,594,592.00	3.08
2	001979	招商蛇口	594,441	9,742,887.99	1.13
3	002285	世联行	799,975	6,079,810.00	0.70
4	600028	中国石化	700,000	3,787,000.00	0.44
5	601328	交通银行	600,000	3,462,000.00	0.40
6	600007	中国国贸	196,000	3,384,920.00	0.39
7	002422	科伦药业	162,000	2,611,440.00	0.30
8	600376	首开股份	150,000	1,771,500.00	0.20
9	600216	浙江医药	100,000	1,268,000.00	0.15
10	300168	万达信息	50,000	1,011,000.00	0.12

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站

www.ncfund.com.cn 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601588	北辰实业	29,938,958.00	3.68
2	601006	大秦铁路	23,087,829.69	2.83
3	001979	招商蛇口	16,779,843.24	2.06
4	000797	中国武夷	13,592,338.50	1.67
5	600048	保利地产	9,579,876.00	1.18
6	601336	新华保险	7,703,647.00	0.95
7	002285	世联行	7,639,029.00	0.94
8	000860	顺鑫农业	7,597,168.27	0.93
9	002588	史丹利	5,899,502.96	0.72
10	002250	联化科技	3,935,017.12	0.48
11	600007	中国国贸	3,780,200.00	0.46
12	601328	交通银行	3,510,000.00	0.43
13	000090	天健集团	3,463,252.00	0.43
14	603968	醋化股份	3,281,653.00	0.40
15	600748	上实发展	2,800,600.00	0.34
16	002422	科伦药业	2,617,500.00	0.32
17	600486	扬农化工	2,411,800.00	0.30
18	600216	浙江医药	2,155,285.00	0.26
19	000768	中航飞机	2,017,080.00	0.25
20	600030	中信证券	1,713,000.00	0.21

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601006	大秦铁路	20,334,593.92	2.50
2	600048	保利地产	17,780,160.73	2.18
3	000797	中国武夷	16,207,865.71	1.99

4	001979	招商蛇口	8,959,974.50	1.10
5	600028	中国石化	8,275,000.00	1.02
6	601336	新华保险	7,826,157.59	0.96
7	000860	顺鑫农业	7,265,505.08	0.89
8	002588	史丹利	5,672,031.00	0.70
9	002250	联化科技	4,771,623.80	0.59
10	600096	云天化	3,941,210.00	0.48
11	000090	天健集团	3,678,056.44	0.45
12	603968	醋化股份	3,371,262.00	0.41
13	601588	北辰实业	2,944,000.00	0.36
14	600748	上实发展	2,916,480.00	0.36
15	600486	扬农化工	2,476,159.00	0.30
16	000768	中航飞机	2,066,257.36	0.25
17	000998	隆平高科	1,990,000.00	0.24
18	600030	中信证券	1,594,274.40	0.20
19	601377	兴业证券	1,526,000.00	0.19
20	002285	世联行	1,256,000.00	0.15

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	167,402,200.56
卖出股票的收入（成交）总额	148,858,983.90

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	182,362,987.50	21.10

5	企业短期融资券	469,795,000.00	54.36
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	265,515.00	0.03
8	同业存单	107,678,000.00	12.46
9	其他	-	-
10	合计	760,101,502.50	87.96

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041651013	16 华电股 CP001	800,000	80,176,000.00	9.28
2	1480228	14 兖城投小微债 01	500,000	51,005,000.00	5.90
3	011698093	16 深航空 SCP006	500,000	50,105,000.00	5.80
4	011698229	16 京国资 SCP001	500,000	50,020,000.00	5.79
5	011698234	16 宁沪高 SCP006	500,000	49,905,000.00	5.77

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属投资。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同尚无股指期货投资政策。

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**

本基金合同尚无国债期货投资政策。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金合同尚无国债期货投资政策。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.12.2 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	85,727.26
2	应收证券清算款	568,728.72
3	应收股利	-
4	应收利息	13,146,558.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,801,014.11

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于可转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金持有前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
11,451	69,909.48	0.00	0.00%	800,533,464.36	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	338,941.49	0.04%

注：本公司所有从业人员持有本基金份额总量为 338,941.49 份。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014 年 4 月 25 日)基金份额总额	560,099,516.80
本报告期期初基金份额总额	800,533,464.36
本报告期基金总申购份额	-
减: 本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	800,533,464.36

注: 本基金属于定期开放基金, 本报告期本基金未开放申购、赎回业务。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 3 月 24 日, 崔建波先生担任本基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理。

2016 年 12 月, 谢永林先生担任平安银行股份有限公司董事、董事长, 上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内, 本基金未发生改聘会计师事务所情况。2016 年, 瑞华会计师事务所为本基金提供审计服务。报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。审计年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期, 本基金无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元 数量	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
方正证券	2	181,900,380.08	58.58%	133,023.64	58.58%	-
光大证券	2	91,166,298.93	29.36%	66,670.07	29.36%	-
东方证券	2	37,426,678.67	12.05%	27,370.06	12.05%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金报告期内共租用6个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

- 3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
方正证券	719,808.00	0.17%	496,600,000.00	27.74%	-	-
光大证券	424,746,471.47	97.84%	58,600,000.00	3.27%	-	-
东方证券	8,643,320.15	1.99%	1,235,200,000.00	68.99%	-	-

注：回购交易不包含非担保交收金额。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

新华基金管理股份有限公司

二〇一七年三月三十一日