

新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金
2016 年年度报告
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 重要提示及目录

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 30 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 | 9 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 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 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 15 |
| 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 | 15 |
| 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 | 16 |
| §6 审计报告 | 16 |
| 6.1 管理层对财务报表的责任 | 16 |
| 6.2 注册会计师的责任 | 16 |
| 6.3 审计意见 | 17 |
| §7 年度财务报表 | 17 |
| 7.1 资产负债表 | 17 |
| 7.2 利润表 | 19 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 20 |
| 7.4 报表附注 | 22 |
| §8 投资组合报告 | 46 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 46 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 47 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 48 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 49 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 51 |
| 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 | 51 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 52 |

| | | |
|------------|-----------------------------------|-----------|
| 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 | 52 |
| 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 | 52 |
| 8.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 52 |
| 8.12 | 投资组合报告附注 | 52 |
| §9 | 基金份额持有人信息 | 53 |
| 9.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 53 |
| 9.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 54 |
| 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 | 54 |
| §10 | 开放式基金份额变动 | 54 |
| §11 | 重大事件揭示 | 54 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 | 54 |
| 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 | 55 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 55 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 | 55 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 55 |
| 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 | 55 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 55 |
| 11.8 | 其他重大事件 | 56 |
| §12 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 58 |
| §13 | 备查文件目录 | 58 |
| 13.1 | 备查文件目录 | 58 |
| 13.2 | 存放地点 | 58 |
| 13.3 | 查阅方式 | 58 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 新华阿鑫二号保本混合 |
| 基金主代码 | 001814 |
| 交易代码 | 001814 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 11 月 19 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 | 1,146,566,354.54 份 |

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的目标。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 | $(\text{一年期银行定期存款税后收益率}+1\%) \times 1.5$ |
| 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 | 010-68779688 | 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 | | 010-68779528 | 0755-82080387 |
| 注册地址 | | 重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层 | 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号 |
| 办公地址 | | 重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层 | 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号 |
| 邮政编码 | | 400010 | 518001 |
| 法定代表人 | | 陈重 | 谢永林 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 |
| 登载基金年度报告正文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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------------|--|
| 会计师事务所 | 瑞华会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层 |
| 注册登记机构 | 新华基金管理股份有限公司 | 重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层 |
| 基金保证人 | 瀚华担保股份有限公司 | 北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心东塔 13F |

§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 11 月 19 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|---|
| 本期已实现收益 | 31,512,122.53 | 1,545,325.60 |
| 本期利润 | 29,898,479.96 | 1,990,653.16 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0261 | 0.1736 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.58% | 1.73% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.59% | 0.20% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | 2015 年末 |
| 期末可供分配利润 | 31,889,133.12 | 1,545,325.60 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0278 | 0.0013 |
| 期末基金资产净值 | 1,178,455,487.66 | 1,148,557,007.70 |
| 期末基金份额净值 | 1.028 | 1.002 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2016 年末 | 2015 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 2.80% | 0.20% |

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与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 | 0.59% | 0.11% | 0.94% | 0.00% | -0.35% | 0.11% |
| 过去六个月 | 1.98% | 0.11% | 1.89% | 0.00% | 0.09% | 0.11% |
| 过去一年 | 2.59% | 0.10% | 3.75% | 0.00% | -1.16% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.80% | 0.10% | 4.19% | 0.00% | -1.39% | 0.10% |

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

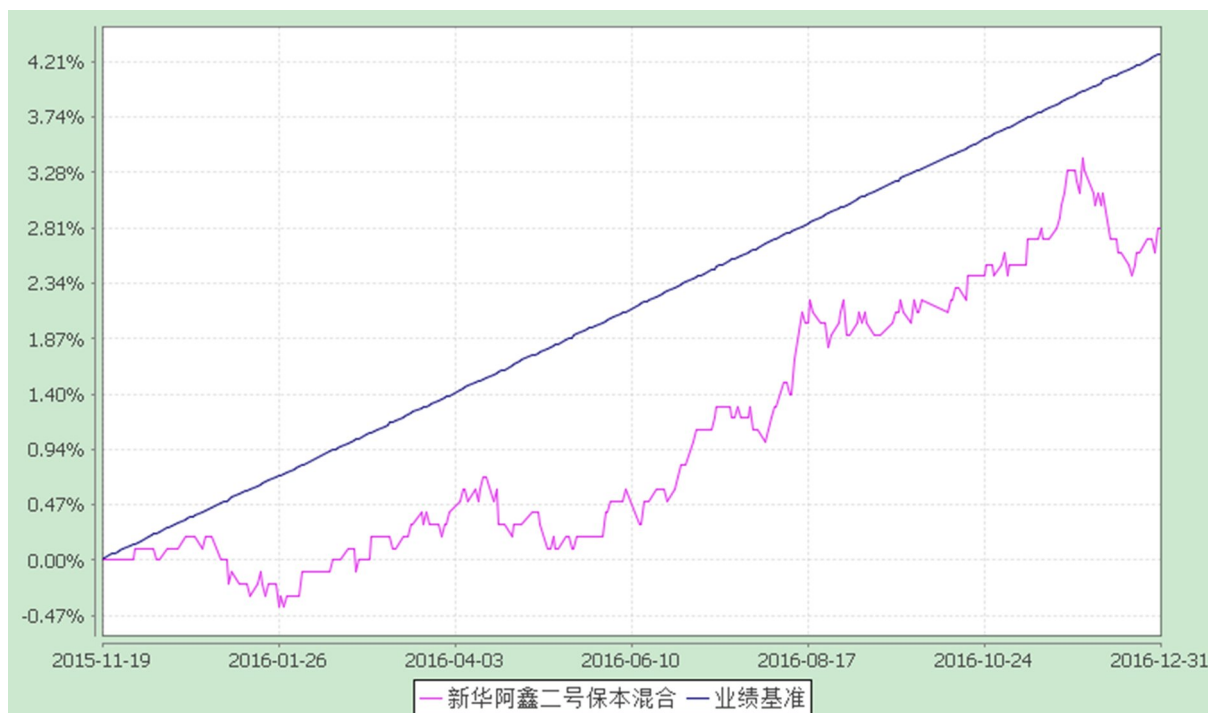
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金

自基金合同生效以来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

(2015 年 11 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日)

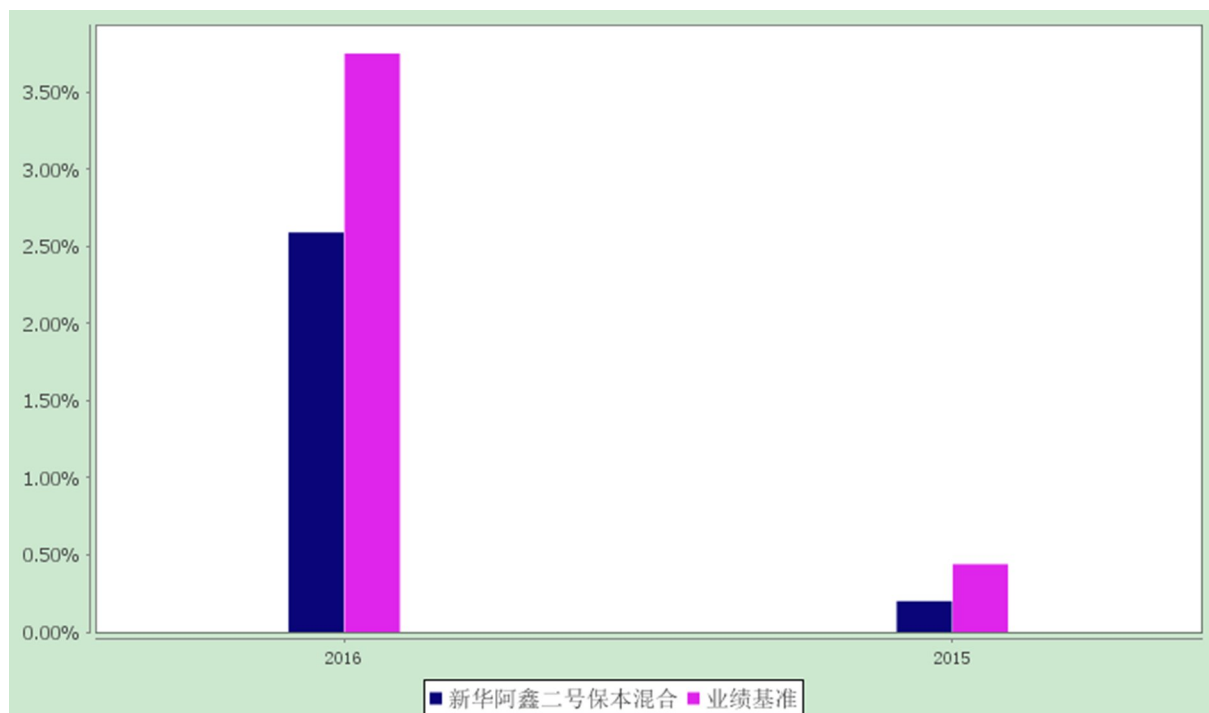


注：报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

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

新华阿鑫二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：本基金于 2015 年 11 月 19 日基金合同生效，合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2015 年 11 月 19 日成立，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、新华丰利债券型证券投资基金基金经理。 | 2015-11-19 | - | 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。 |

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鑫二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》、《新华阿鑫二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所对手询价、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。

基金管理人对旗下所有投资组合间连续 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 1.028 元,本报告期份额净值增长率为 2.59%,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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定的要求，完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

二、督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

三、根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

四、在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部对公司员工进行了法律法规的专项培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

通过上述工作，在本报告期内，公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.7.1.1 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。

4.7.1.2 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。

4.7.1.3 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询；
- 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。

4.7.1.4 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。

4.7.1.5 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

§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”）在对新华阿鑫二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。

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。

§6 审计报告

瑞华审字[2017]01360114 号

新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金（以下简称“新华阿鑫二号保本基金”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是新华阿鑫二号保本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司管理层的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估

计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金 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。

瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

张伟 胡慰

北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层

2017 年 3 月 30 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华阿鑫二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 | 附注号 | 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 | 7.4.7.1 | 31,579,145.87 | 23,698,114.96 |
| 结算备付金 | | 96,060.23 | 22,600,597.34 |
| 存出保证金 | | 64,346.33 | 9,308.10 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,155,850,207.52 | 602,350,957.13 |
| 其中：股票投资 | | 124,168,171.92 | 28,319,000.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,031,682,035.60 | 574,031,957.13 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | 114,000,270.00 |

| | | | |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收证券清算款 | | - | 383,794,845.38 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 9,377,294.94 | 8,960,515.15 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,196,967,054.89 | 1,155,414,608.06 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 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 | | 17,192,855.78 | 5,812,515.62 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 798,865.58 | 779,908.01 |
| 应付托管费 | | 99,858.19 | 97,488.49 |
| 应付销售服务费 | | 99,858.19 | 97,488.49 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 60,129.49 | 25,432.88 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 260,000.00 | 44,766.87 |
| 负债合计 | | 18,511,567.23 | 6,857,600.36 |
| 所有者权益: | | - | - |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,146,566,354.54 | 1,146,566,354.54 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 31,889,133.12 | 1,990,653.16 |

| | | | |
|------------|--|-------------------------|-------------------------|
| 所有者权益合计 | | 1,178,455,487.66 | 1,148,557,007.70 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,196,967,054.89 | 1,155,414,608.06 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.028 元，基金份额总额 1,146,566,354.54 份。

7.2 利润表

会计主体：新华阿鑫二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 | 附注号 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2015 年 11 月 19 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|---|---|
| 一、收入 | | 42,499,235.82 | 3,383,211.00 |
| 1.利息收入 | | 25,699,189.24 | 2,937,883.44 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 228,862.53 | 162,317.04 |
| 债券利息收入 | | 23,190,611.63 | 449,405.77 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,279,715.08 | 2,326,160.63 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 18,413,689.15 | - |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12.2 | 12,363,499.66 | - |
| 基金投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.14.2 | 4,662,008.49 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.14.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.17 | 1,388,181.00 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | -1,613,642.57 | 445,327.56 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------------|---------------------|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.19 | - | - |
| 减：二、费用 | | 12,600,755.86 | 1,392,557.84 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 9,279,423.07 | 1,056,334.84 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 1,159,927.87 | 132,041.84 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 1,159,927.87 | 132,041.84 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.20 | 276,279.05 | 26,972.45 |
| 5. 利息支出 | | 237,298.71 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 237,298.71 | - |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.21 | 487,899.29 | 45,166.87 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 29,898,479.96 | 1,990,653.16 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 29,898,479.96 | 1,990,653.16 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华阿鑫二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） | 1,146,566,354.54 | 1,990,653.16 | 1,148,557,007.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 29,898,479.96 | 29,898,479.96 |
| 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） | 1,146,566,354.54 | 31,889,133.12 | 1,178,455,487.66 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2015 年 11 月 19 日（基金合同生效日）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） | 1,146,566,354.54 | - | 1,146,566,354.54 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,990,653.16 | 1,990,653.16 |
| 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） | 1,146,566,354.54 | 1,990,653.16 | 1,148,557,007.70 |

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

新华阿鑫二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”）证监许可【2015】1918 号文《关于准予新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，由新华基金管理股份有限公司发起募集的契约型开放式混合型证券投资基金，存续期不设定。于 2015 年 11 月 11 日通过新华基金管理股份有限公司的直销中心公开发售，发行期限：2015 年 11 月 11 日至 2015 年 11 月 17 日。首次募集资金总额 1,146,566,354.54 元，其中募集资金产生利息 74,354.54 元，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2015]第 01360024 号验资报告予以验证。2015 年 11 月 19 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。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《新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金招募说明书》及《新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金将依照投资组合保本策略将基金资产配置于固定收益资产与风险资产：固定收益资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据和政策性金融债、企业债、中小企业私募债券、可转换公司债（含分离交易的可转换公司债券）、短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具和银行存款等固定收益资产；风险资产为股票、权证等权益类资产。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 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%，在保本周期内（保本周期到期日除外），本基金不受该比例的限制。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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》、《新华阿鑫二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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息（作为应收利息单独核算）。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

（3）权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

（4）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算。

（5）买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。

买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

（6）卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。

卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。

存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

(2) 主要资产的估值方法

① 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

②债券投资

对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种（含上交所可交换债），选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值净价作为公允价值。

对在交易所市场上市交易的可转换债券（含深交所可交换债券），采用交易所每日收盘价（估值全价）扣减上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券、私募债券和未上市债券，采用成本估值。

对于银行间市场上的固定收益品种，选取中国债券登记结算有限公司提供的相应品种当日的估值净价加上上一起息日至估值日每百元债券的税前应计利息（算头算尾）减去上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

③如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值

的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于月末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提；

(3) 基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、保本周期内,仅采取现金分红一种收益分配方式,不进行红利再投资;
- 2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;
- 3、每一基金份额享有同等分配权;
- 4、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 31,579,145.87 | 23,698,114.96 |
| 定期存款 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计 | 31,579,145.87 | 23,698,114.96 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 | | |
|---------------|-------|------------------|------------------|---------------|
| | | 2016 年 12 月 31 日 | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 123,086,430.29 | 124,168,171.92 | 1,081,741.63 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 337,980.07 | 368,035.60 | 30,055.53 |
| | 银行间市场 | 1,033,594,112.17 | 1,031,314,000.00 | -2,280,112.17 |
| | 合计 | 1,033,932,092.24 | 1,031,682,035.60 | -2,250,056.64 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 1,157,018,522.53 | 1,155,850,207.52 | -1,168,315.01 |
| 项目 | | 上年度末 | | |
| | | 2015 年 12 月 31 日 | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 28,288,172.00 | 28,319,000.00 | 30,828.00 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 651,957.13 | 651,957.13 | - |
| | 银行间市场 | 572,965,500.44 | 573,380,000.00 | 414,499.56 |
| | 合计 | 573,617,457.57 | 574,031,957.13 | 414,499.56 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 601,905,629.57 | 602,350,957.13 | 445,327.56 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | |
|-----|--------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 合计 | - | - |
| 项目 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间 | 100,000,270.00 | - |
| 交易所 | 14,000,000.00 | - |
| 合计 | 114,000,270.00 | - |

注：本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 3,434.74 | 16,947.83 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 72.10 | 10,174.50 |
| 应收债券利息 | 9,373,788.10 | 1,035,536.10 |
| 应收买入返售证券利息 | - | 15,782.42 |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 其他 | - | 7,882,074.30 |

| | | |
|----|--------------|--------------|
| 合计 | 9,377,294.94 | 8,960,515.15 |
|----|--------------|--------------|

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|-------------|------------------|------------------|
| | 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 12 月 31 日 |
| 交易所市场应付交易费用 | 52,431.95 | 20,788.38 |
| 银行间市场应付交易费用 | 7,697.54 | 4,644.50 |
| 合计 | 60,129.49 | 25,432.88 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|-------------|------------------|------------------|
| | 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 12 月 31 日 |
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 其他应付款 | - | - |
| 预提费用 | 260,000.00 | 44,766.87 |
| 合计 | 260,000.00 | 44,766.87 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|---------------|----------------------------------|------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,146,566,354.54 | 1,146,566,354.54 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |

| | | |
|-----|------------------|------------------|
| 本期末 | 1,146,566,354.54 | 1,146,566,354.54 |
|-----|------------------|------------------|

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 1,545,325.60 | 445,327.56 | 1,990,653.16 |
| 本期利润 | 31,512,122.53 | -1,613,642.57 | 29,898,479.96 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 33,057,448.13 | -1,168,315.01 | 31,889,133.12 |

7.4.7.11 存款利息收入

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11月19日（基金合 同生效日）至2015年12月 31日 |
|-----------|---------------------------------|---|
| 活期存款利息收入 | 188,085.90 | 132,811.08 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 40,776.63 | 29,505.96 |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 228,862.53 | 162,317.04 |

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------|-----------------------|----------------------------------|
| | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年11月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
| 卖出股票成交总额 | 75,587,910.41 | - |
| 减: 卖出股票成本总额 | 63,224,410.75 | - |
| 买卖股票差价收入 | 12,363,499.66 | - |

注: 本基金上年度可比期间无卖出股票。

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间未持有基金投资。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------------------|-----------------------|----------------------------------|
| | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年11月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
| 债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入 | 4,662,008.49 | - |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 合计 | 4,662,008.49 | - |

注: 本基金上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------------|-----------------------|----------------------------------|
| | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年11月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
| 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额 | 2,173,052,964.85 | - |
| 减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额 | 2,130,063,357.23 | - |
| 减: 应收利息总额 | 38,327,599.13 | - |
| 买卖债券差价收入 | 4,662,008.49 | - |

注: 本基金上年度可比期间未卖出债券。

7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间未持有资产支持证券投资。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间未持有贵金属投资。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间未持有衍生工具投资。

7.4.7.17 股利收益

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11月19日（基金合同生效 日）至2015年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,388,181.00 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 1,388,181.00 | - |

注：本基金上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年11月19日（基金合同生效 日）至2015年12月31日 |
|------------|-----------------------------|---|
| 1.交易性金融资产 | -1,613,642.57 | 445,327.56 |
| ——股票投资 | 1,050,913.63 | 30,828.00 |
| ——债券投资 | -2,664,556.20 | 414,499.56 |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——基金投资 | - | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |

| | | |
|--------|---------------|------------|
| 2.衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3.其他 | - | - |
| 合计 | -1,613,642.57 | 445,327.56 |

7.4.7.19 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.20 交易费用

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11月19日（基金合同生效日）至 2015年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 262,699.05 | 23,297.45 |
| 银行间市场交易费用 | 13,580.00 | 3,675.00 |
| 合计 | 276,279.05 | 26,972.45 |

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|---------------------------|--------------------------------------|
| | 2016年1月1日至2016年12月 31日 | 2015年11月19日（基金合同生效日） 至2015年12月31日 |
| 审计费用 | 80,000.00 | - |
| 信息披露费 | 379,999.29 | 44,766.87 |
| 债券账户维护费 | 27,900.00 | - |
| 汇划手续费 | - | - |
| 其他 | - | 400.00 |
| 合计 | 487,899.29 | 45,166.87 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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 |
| 平安银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 恒泰证券股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 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 | 基金管理人的控股子公司 |
| 新华信托股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 中国平安保险（集团）股份有限公司 | 基金托管人股东 |

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行交易。

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 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交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|-----------------------|----------------------------------|
| | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年11月19日（基金合同生效日）至2015年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 9,279,423.07 | 1,056,334.84 |
| 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 0.80% 的年费率逐日计提确认。计算公式为：每日基金管理费=前一日基金资产净值×（0.80%÷当年天数）；

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|----------------------------------|
| | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年11月19日（基金合同生效日）至2015年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,159,927.87 | 132,041.84 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法为：每日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数；

7.4.10.2.3 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 | 1,159,927.87 |
| 合计 | 1,159,927.87 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 |
| | 2015年11月19日（基金合同生效日）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 | 132,041.84 |
| 合计 | 132,041.84 |

注：基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率逐日计提确认。计算公式为：每日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 × (0.10% ÷ 当年天数)；

7.4.10.3 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发生与关联方进行银行间同业市场的债券交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年11月19日(基金合同生效日) 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 | 31,579,145.87 | 188,085.90 | 23,698,114.96 | 132,811.08 |

7.4.10.6 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在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

报告截至 2016 年 12 月 31 日止无收益分配事项。

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

7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 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 | 皖天然气 | 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 | - |
| 300583 | 赛托生物 | 2016-12-29 | 2017-01-06 | 网下中签 | 40.29 | 40.29 | 1,582.00 | 63,738.78 | 63,738.78 | - |
| 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 | - |
| 300587 | 天铁股份 | 2016-12-28 | 2017-01-05 | 网下中签 | 14.11 | 14.11 | 1,438.00 | 20,290.18 | 20,290.18 | - |
| 300588 | 熙菱信息 | 2016-12-27 | 2017-01-06 | 网下中签 | 4.94 | 4.94 | 1,380.00 | 6,817.20 | 6,817.20 | - |
| 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 | - |

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2016年12月31日 | 上年末 2015年12月31日 |
|--------|--------------------|--------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 778,463,000.00 | - |
| 合计 | 778,463,000.00 | - |

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2016年12月31日 | 上年末 2015年12月31日 |
|--------|--------------------|--------------------|
| AAA | 170,530.60 | - |
| AAA 以下 | 197,505.00 | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 368,035.60 | - |

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------------|------------------|-------|-------|----------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 31,579,145.87 | - | - | - | 31,579,145.87 |
| 结算备付金 | 96,060.23 | - | - | - | 96,060.23 |
| 存出保证金 | 64,346.33 | - | - | - | 64,346.33 |
| 交易性金融资产 | 1,031,682,035.60 | - | - | 124,168,171.92 | 1,155,850,207.52 |
| 应收利息 | - | - | - | 9,377,294.94 | 9,377,294.94 |
| 资产总计 | 1,063,421,588.03 | - | - | 133,545,466.86 | 1,196,967,054.89 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 17,192,855.78 | 17,192,855.78 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 798,865.58 | 798,865.58 |
| 应付托管费 | - | - | - | 99,858.19 | 99,858.19 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 99,858.19 | 99,858.19 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 60,129.49 | 60,129.49 |
| 其他负债 | - | - | - | 260,000.00 | 260,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 18,511,567.23 | 18,511,567.23 |
| 利率敏感度缺口 | 1,063,421,588.03 | - | - | 115,033,899.63 | 1,178,455,487.66 |
| 上年度末 2015 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 23,698,114.96 | - | - | - | 23,698,114.96 |
| 结算备付金 | 22,600,597.34 | - | - | - | 22,600,597.34 |
| 存出保证金 | 9,308.10 | - | - | - | 9,308.10 |
| 交易性金融资产 | 574,031,957.13 | - | - | 28,319,000.00 | 602,350,957.13 |
| 应收利息 | - | - | - | 8,960,515.15 | 8,960,515.15 |
| 资产总计 | 620,339,977.53 | - | - | 37,279,515.15 | 657,619,492.68 |

| | | | | | |
|---------|----------------|---|---|---------------|----------------|
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 5,812,515.62 | 5,812,515.62 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 779,908.01 | 779,908.01 |
| 应付托管费 | - | - | - | 97,488.49 | 97,488.49 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 97,488.49 | 97,488.49 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 25,432.88 | 25,432.88 |
| 其他负债 | - | - | - | 44,766.87 | 44,766.87 |
| 负债总计 | - | - | - | 6,857,600.36 | 6,857,600.36 |
| 利率敏感度缺口 | 620,339,977.53 | - | - | 30,421,914.79 | 650,761,892.32 |

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|------------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 假设 | 其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点 | | |
| | 其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
| | 市场利率上升 25.00 bp | 增加约 2,658,553.97 | 增加约 1,550,849.94 |
| | 市场利率下降 25.00 bp | 减少约 2,658,553.97 | 减少约 1,550,849.94 |

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产与负债均以人民币计价,因此无重大外汇风险.

7.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| | | |
|----|-----|------|
| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|------|

| | 2016 年 12 月 31 日 | | 2015 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------|--------------------------|------------------|--------------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 124,168,171.92 | 10.54 | 28,319,000.00 | 2.47 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 1,031,682,035.60 | 87.55 | 574,031,957.13 | 49.98 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,155,850,207.52 | 98.08 | 602,350,957.13 | 52.44 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 其他市场变量不变,本基金业绩比较基准上升 1% | | |
|----|-------------------------|-------------------------------|--------------------------|
| | 其他市场变量不变,本基金业绩比较基准下降 1% | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元) | |
| | | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
| | 本基金业绩比较基准上升 1% | 增加约 553,955.41 | 增加约 288,684.09 |
| | 本基金业绩比较基准下降 1% | 减少约 553,955.41 | 减少约 288,684.09 |

注: 1. 本基金的整体业绩比较基准为(一年期银行定期存款税后收益率+1%) *1.5;

2. 本基金管理人运用 XRisk suite 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价格风险的敏感性分析。

§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 | 124,168,171.92 | 10.37 |
| | 其中：股票 | 124,168,171.92 | 10.37 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,031,682,035.60 | 86.19 |
| | 其中：债券 | 1,031,682,035.60 | 86.19 |
| | 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 | 31,675,206.10 | 2.65 |
| 7 | 其他各项资产 | 9,441,641.27 | 0.79 |
| 8 | 合计 | 1,196,967,054.89 | 100.00 |

8.2 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

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 9,738,000.00 | 0.83 |
| C | 制造业 | 5,000,102.00 | 0.42 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 37,917.66 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 118,924.74 | 0.01 |
| 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 | 241,692.20 | 0.02 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业 | 1,420,180.00 | 0.12 |
| K | 房地产业 | 105,864,396.64 | 8.98 |
| 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 | 1,737,500.00 | 0.15 |
| 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 | 124,168,171.92 | 10.54 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 11,568,766 | 48,241,754.22 | 4.09 |
| 2 | 000797 | 中国武夷 | 804,056 | 14,046,858.32 | 1.19 |
| 3 | 001979 | 招商蛇口 | 814,000 | 13,341,460.00 | 1.13 |
| 4 | 600048 | 保利地产 | 1,400,000 | 12,782,000.00 | 1.08 |
| 5 | 600028 | 中国石化 | 1,800,000 | 9,738,000.00 | 0.83 |
| 6 | 002146 | 荣盛发展 | 800,000 | 6,280,000.00 | 0.53 |
| 7 | 002285 | 世联行 | 500,000 | 3,800,000.00 | 0.32 |
| 8 | 600223 | 鲁商置业 | 550,000 | 2,992,000.00 | 0.25 |
| 9 | 600376 | 首开股份 | 200,000 | 2,362,000.00 | 0.20 |
| 10 | 000060 | 中金岭南 | 200,000 | 2,230,000.00 | 0.19 |
| 11 | 000069 | 华侨城 A | 250,000 | 1,737,500.00 | 0.15 |
| 12 | 002250 | 联化科技 | 100,000 | 1,618,000.00 | 0.14 |
| 13 | 601336 | 新华保险 | 30,000 | 1,313,400.00 | 0.11 |
| 14 | 600340 | 华夏幸福 | 48,319 | 1,154,824.10 | 0.10 |
| 15 | 600007 | 中国国贸 | 50,000 | 863,500.00 | 0.07 |
| 16 | 600996 | 贵广网络 | 12,500 | 234,875.00 | 0.02 |
| 17 | 603823 | 百合花 | 3,762 | 123,167.88 | 0.01 |
| 18 | 601375 | 中原证券 | 26,695 | 106,780.00 | 0.01 |
| 19 | 603098 | 森特股份 | 4,293 | 103,332.51 | 0.01 |
| 20 | 603298 | 杭叉集团 | 3,641 | 88,403.48 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 21 | 603228 | 景旺电子 | 3,491 | 80,851.56 | 0.01 |
| 22 | 603878 | 武进不锈 | 2,000 | 80,000.00 | 0.01 |
| 23 | 002832 | 比音勒芬 | 1,158 | 70,290.60 | 0.01 |
| 24 | 603577 | 汇金通 | 2,460 | 69,642.60 | 0.01 |
| 25 | 603218 | 日月股份 | 1,652 | 68,805.80 | 0.01 |
| 26 | 603877 | 太平鸟 | 3,180 | 67,734.00 | 0.01 |
| 27 | 300583 | 塞托生物 | 1,582 | 63,738.78 | 0.01 |
| 28 | 002826 | 易明医药 | 2,181 | 57,316.68 | 0.00 |
| 29 | 603416 | 信捷电气 | 1,076 | 53,886.08 | 0.00 |
| 30 | 002833 | 弘亚数控 | 2,743 | 48,331.66 | 0.00 |
| 31 | 603389 | 亚振家居 | 1,963 | 47,327.93 | 0.00 |
| 32 | 603886 | 元祖股份 | 2,241 | 39,665.70 | 0.00 |
| 33 | 603689 | 皖天然气 | 4,818 | 37,917.66 | 0.00 |
| 34 | 300582 | 英飞特 | 1,359 | 35,157.33 | 0.00 |
| 35 | 603239 | 浙江仙通 | 924 | 29,059.80 | 0.00 |
| 36 | 002835 | 同为股份 | 1,126 | 24,220.26 | 0.00 |
| 37 | 603035 | 常熟汽饰 | 2,316 | 24,179.04 | 0.00 |
| 38 | 603266 | 天龙股份 | 1,562 | 22,852.06 | 0.00 |
| 39 | 300587 | 天铁股份 | 1,438 | 20,290.18 | 0.00 |
| 40 | 603929 | 亚翔集成 | 2,193 | 15,592.23 | 0.00 |
| 41 | 002838 | 道恩股份 | 681 | 10,405.68 | 0.00 |
| 42 | 603186 | 华正新材 | 1,874 | 10,063.38 | 0.00 |
| 43 | 603032 | 德新交运 | 1,628 | 9,458.68 | 0.00 |
| 44 | 300586 | 美联新材 | 1,006 | 9,355.80 | 0.00 |
| 45 | 300591 | 万里马 | 2,396 | 7,355.72 | 0.00 |
| 46 | 300588 | 熙菱信息 | 1,380 | 6,817.20 | 0.00 |

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 | 53,319,156.29 | 4.64 |
| 2 | 000797 | 中国武夷 | 28,099,906.00 | 2.45 |
| 3 | 001979 | 招商蛇口 | 12,717,029.00 | 1.11 |
| 4 | 600048 | 保利地产 | 9,254,000.00 | 0.81 |
| 5 | 000090 | 天健集团 | 6,827,443.00 | 0.59 |
| 6 | 600759 | 洲际油气 | 6,802,930.10 | 0.59 |
| 7 | 002285 | 世联行 | 5,599,000.00 | 0.49 |
| 8 | 002250 | 联化科技 | 4,005,000.00 | 0.35 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 9 | 000069 | 华侨城 A | 3,690,000.00 | 0.32 |
| 10 | 601006 | 大秦铁路 | 3,368,000.00 | 0.29 |
| 11 | 600223 | 鲁商置业 | 3,335,000.00 | 0.29 |
| 12 | 000060 | 中金岭南 | 3,209,113.00 | 0.28 |
| 13 | 600340 | 华夏幸福 | 2,347,307.40 | 0.20 |
| 14 | 002146 | 荣盛发展 | 1,459,000.00 | 0.13 |
| 15 | 600683 | 京投发展 | 1,380,000.00 | 0.12 |
| 16 | 601336 | 新华保险 | 1,275,300.00 | 0.11 |
| 17 | 000630 | 铜陵有色 | 1,124,000.00 | 0.10 |
| 18 | 603968 | 醋化股份 | 1,093,600.00 | 0.10 |
| 19 | 000043 | 中航地产 | 1,047,822.00 | 0.09 |
| 20 | 600007 | 中国国贸 | 981,000.00 | 0.09 |

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 | 000797 | 中国武夷 | 16,559,151.00 | 1.44 |
| 2 | 600759 | 洲际油气 | 7,139,611.20 | 0.62 |
| 3 | 000090 | 天健集团 | 7,133,037.33 | 0.62 |
| 4 | 601588 | 北辰实业 | 4,260,667.88 | 0.37 |
| 5 | 002250 | 联化科技 | 3,148,300.00 | 0.27 |
| 6 | 600096 | 云天化 | 2,583,000.00 | 0.22 |
| 7 | 601006 | 大秦铁路 | 2,508,000.00 | 0.22 |
| 8 | 000069 | 华侨城 A | 1,770,000.00 | 0.15 |
| 9 | 002470 | 金正大 | 1,512,000.00 | 0.13 |
| 10 | 600683 | 京投发展 | 1,449,893.00 | 0.13 |
| 11 | 002285 | 世联行 | 1,325,795.00 | 0.12 |
| 12 | 600340 | 华夏幸福 | 1,223,186.00 | 0.11 |
| 13 | 000043 | 中航地产 | 1,190,570.00 | 0.10 |
| 14 | 600028 | 中国石化 | 1,098,000.00 | 0.10 |
| 15 | 000630 | 铜陵有色 | 1,088,000.00 | 0.09 |
| 16 | 000060 | 中金岭南 | 1,087,000.00 | 0.09 |
| 17 | 603968 | 醋化股份 | 1,048,302.34 | 0.09 |
| 18 | 600162 | 香江控股 | 630,000.00 | 0.05 |
| 19 | 600977 | 中国电影 | 586,661.14 | 0.05 |
| 20 | 600909 | 华安证券 | 582,688.12 | 0.05 |

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 | 158,022,669.04 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 75,587,910.41 |

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 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 778,463,000.00 | 66.06 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 197,505.00 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | 252,851,000.00 | 21.46 |
| 9 | 其他 | 170,530.60 | 0.01 |
| 10 | 合计 | 1,031,682,035.60 | 87.55 |

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 | 011698280 | 16 南航股 SCP006 | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 8.49 |
| 2 | 011698456 | 16 大唐发 | 1,000,000 | 99,600,000.00 | 8.45 |

| | | | | | |
|---|-----------|-----------------|-----------|---------------|------|
| | | 电 SCP006 | | | |
| 3 | 111606002 | 16 交行 CD002 | 1,000,000 | 96,580,000.00 | 8.20 |
| 4 | 011698646 | 16 首发 SCP001 | 800,000 | 79,792,000.00 | 6.77 |
| 5 | 011698076 | 16 广晟 SCP005 | 600,000 | 59,976,000.00 | 5.09 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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。

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投资。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

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

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期本基金无国债期货持仓。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期末本基金投资的前十名证券没有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,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 | 64,346.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,377,294.94 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,441,641.27 |

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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 |
| | | | | | |

| | | | | | |
|--------|-----------|------|-------|------------------|---------|
| 22,224 | 51,591.36 | 0.00 | 0.00% | 1,146,566,354.54 | 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 | 1,880,806.37 | 0.16% |

注：本公司所有从业人员持有本基金份额总量为1,880,806.37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 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

注：本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为10~50万份；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0~10万份。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2015年11月19日)基金份额总额 | 1,146,566,354.54 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,146,566,354.54 |
| 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 | 1,146,566,354.54 |

注：本基金2015年11月19日合同生效，封闭期两年，至2016年12月31日本基金尚处于封闭期。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金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

本报告期末未有涉及基金管理人、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未发生改变。

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。报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。2016 年，瑞华会计师事务所为本基金提供审计服务。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

本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

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 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 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 | 121,248,632.57 | 53.33% | 89,204.44 | 53.48% | - |
| 光大证券 | 2 | 75,418,740.01 | 33.17% | 55,153.99 | 33.07% | - |
| 东方证券 | 2 | 30,688,488.62 | 13.50% | 22,442.57 | 13.45% | - |

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 | 719,831.40 | 3.86% | 348,600,000.00 | 48.22% | - | - |
| 光大证券 | 1,966,963.30 | 10.53% | 45,500,000.00 | 6.29% | - | - |
| 东方证券 | 15,984,430.70 | 85.61% | 328,900,000.00 | 45.49% | - | - |

注：回购交易不包含非担保交收金额。

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--------------------|-------------|------------|
| 1 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 | 中国证券报、证券时报、 | 2016-01-04 |

| | | | |
|----|---|------------------------------------|------------|
| | 2015 年年度资产净值的公告 | 上海证券报、证券日报、 公司网站 | |
| 2 | 新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-03-25 |
| 3 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加新兰德开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-03-26 |
| 4 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加众禄基金开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-03-28 |
| 5 | 新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-04-21 |
| 6 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-04-25 |
| 7 | 新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销系统招商银行网银支付费率优惠的公告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-04-29 |
| 8 | 新华基金管理股份有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-05-05 |
| 9 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2016 年半年度资产净值的公告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-07-01 |
| 10 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金通过上海浦东发展银行股份有限公司申购基金费率优惠的公告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-07-02 |
| 11 | 新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-07-02 |
| 12 | 新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）全文 | 公司网站 | 2016-07-02 |
| 13 | 新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-07-18 |
| 14 | 新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-08-24 |
| 15 | 新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-10-26 |
| 16 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参 | 中国证券报、证券时报、 | 2016-11-09 |

| | | | |
|----|---|------------------------------------|------------|
| | 加和讯开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告 | 上海证券报、证券日报、 公司网站 | |
| 17 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加钱景财富开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-11-29 |
| 18 | 新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-12-30 |
| 19 | 新华阿鑫二号保本混合型证券投资 基金招募说明书全文 | 公司网站 | 2016-12-30 |
| 20 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2016 年年度最后一个交易日资产净值揭示公告 | 中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站 | 2016-12-31 |

§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。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金募集的文件
- （二）关于申请募集新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金之法律意见书
- （三）新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金托管协议
- （四）新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同
- （五）新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- （六）更新的《新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金招募说明书》
- （七）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （八）基金托管人业务资格批件及营业执照
- （九）中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇一七年三月三十一日