

新华丰利债券型证券投资基金
2017 年半年度报告摘要
2017 年 6 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：二〇一七年八月二十九日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华丰利债券	
基金主代码	003221	
交易代码	003221	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 10 月 26 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	
报告期末基金份额总额	369,326,998.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华丰利债券 A	新华丰利债券 C
下属分级基金的交易代码	003221	003222
报告期末下属分级基金的份额总额	230,861,652.38 份	138,465,345.65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险并保持较高资产流动性的前提下，通过配置债券等固定收益类金融工具，追求基金资产的长期稳定增值，通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。首先，本基金管理人将采用战略性与战术性相结合的大类资产配置策略，在基金合同规定的投资比例范围内确定各大类资产的配置比例，在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定的绝对收益。另外，本基金通过自下而上的个股精选策略，精选具有持续成长且估值相对合理的股票构建权益类资产投资组合，增加基金的获利能力，以提高整体的收益水平。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	郭明
	联系电话	010-68779688	010-66105799
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	4008198866	95588
传真	010-68779528	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）	
	新华丰利债券 A	新华丰利债券 C
本期已实现收益	4,896,368.90	3,445,092.72
本期利润	5,944,119.62	4,291,979.15
加权平均基金份额本期利润	0.0188	0.0152
本期基金份额净值增长率	2.14%	1.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
	新华丰利债券 A	新华丰利债券 C
期末可供分配基金份额利润	0.0205	0.0176
期末基金资产净值	236,283,079.44	141,315,610.22
期末基金份额净值	1.0235	1.0206

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、本基金于 2016 年 10 月 26 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

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

新华丰利债券 A

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
过去一个月	1.82%	0.16%	1.31%	0.09%	0.51%	0.07%

过去三个月	1.30%	0.18%	-0.19%	0.11%	1.49%	0.07%
过去六个月	2.14%	0.13%	-0.88%	0.10%	3.02%	0.03%
自基金合同生效起至今	2.35%	0.11%	-3.24%	0.13%	5.59%	-0.02%

新华丰利债券 C

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
过去一个月	1.79%	0.17%	1.31%	0.09%	0.48%	0.08%
过去三个月	1.19%	0.17%	-0.19%	0.11%	1.38%	0.06%
过去六个月	1.92%	0.13%	-0.88%	0.10%	2.80%	0.03%
自基金合同生效起至今	2.06%	0.11%	-3.24%	0.13%	5.30%	-0.02%

注：1、本基金于 2016 年 10 月 26 日基金合同生效，至 2017 年 6 月 30 日披露日未满一年。

2、本基金业绩比较基准为中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。

3、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

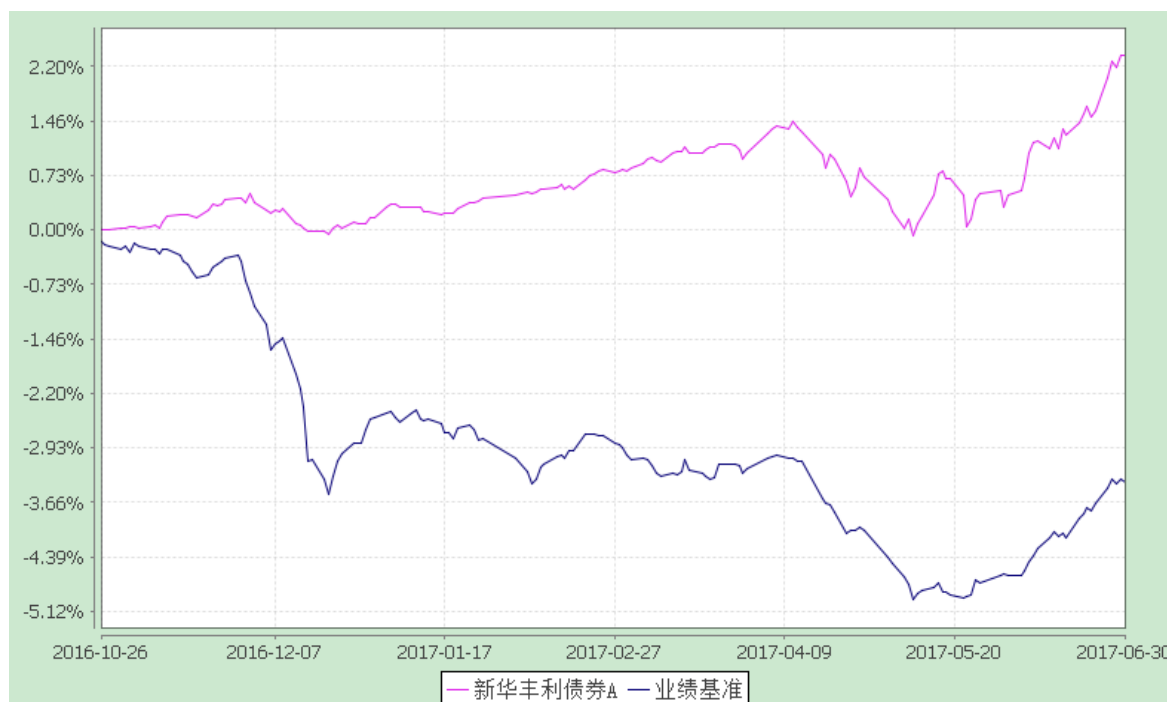
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华丰利债券型证券投资基金

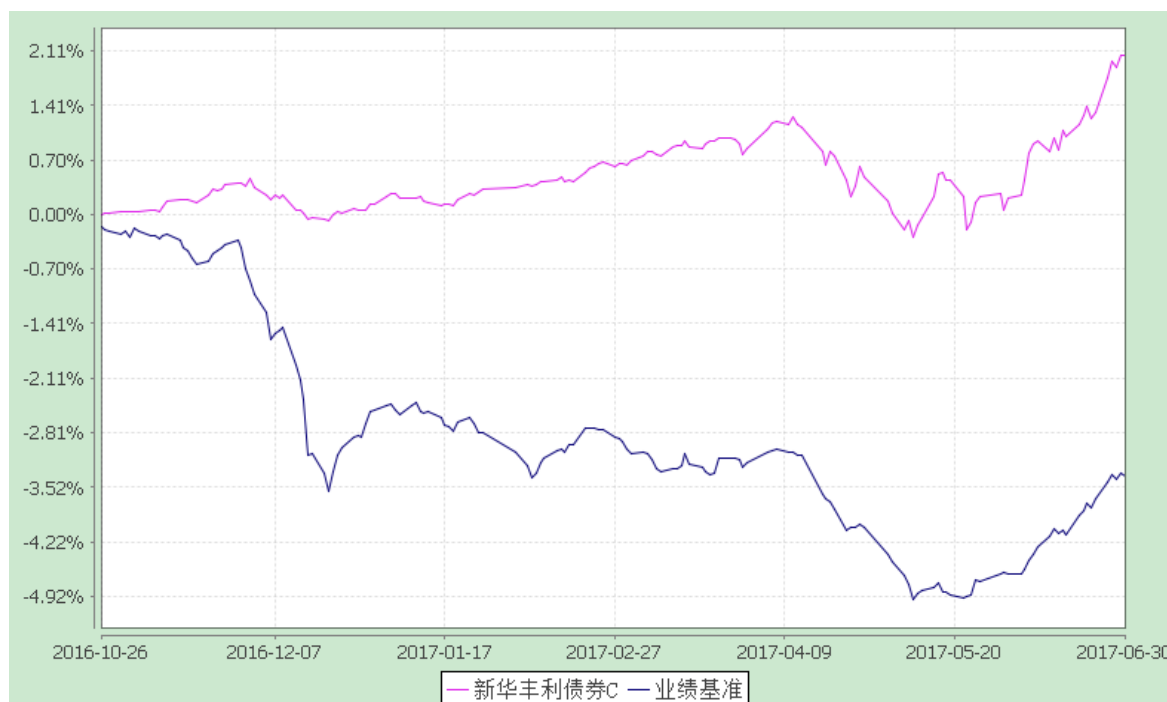
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 10 月 26 日至 2017 年 6 月 30 日)

新华丰利债券 A



新华丰利债券 C



注：本基金于 2016 年 10 月 26 日成立，报告截止日 2017 年 6 月 30 日未满一年。

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 2017 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十七只开放式基金，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、新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）、新华鑫益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、新华鑫利灵活配置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、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华华盛灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫丰灵活配置混合型证券投资基金和新华鑫裕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、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理。	2016-10-26	-	8	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、新华红利回报混合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丰利债券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》、《新华丰利债券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。

4.3.2 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

2017 年上半年，月度数据及高频数据显示经济增速和通胀水平在经历景气高点后有所回落，工业企业利润增速也有所下降。部分周期性较强的上市公司受库存周期影响，业绩仍有向好趋势，收入、利润增速和现金流状况均有改善，但持续性仍有待于进一步观察。

股票方面，我们对由市场风格导致的蓝筹偏好行情持谨慎态度，对其中的周期性品种采取了适度回避的策略；我们适当增配了一些前期受市场关注度较低但发展前景较好且业绩增速较快的标的。我们并不尝试预测蓝筹行情何时终结，而是从公司自身价值及成长性出发甄选标的，如果市场风格不断向极端方向演进，则会给基本面投资者带来更好的买入机会。

债券方面，我们适当拉长了组合久期，使得组合的到期收益率有所上行，但利率风险暴露仍然较小。随着存量债券的到期，我们新增的债券投资久期主要分布在在 1-3 年。转债方面，由于优质

标的稀缺、部分新上市的大盘转债转股溢价率仍然较高，我们仅参与了一级市场申购，依然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 2017 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0235 元，本报告期份额净值增长率为 2.14%，同期比较基准的增长率为-0.88%；本基金 C 类份额净值为 1.0206 元，本报告期份额净值增长率为 1.92%，同期比较基准的增长率为-0.88%。

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 年下半年，经济增长的惯性仍然存在，地产、基建等仍是总需求中的重要力量，供给侧改革带来的价格体系调整在短期内对经济也有一定贡献，但如果产能退出过多，则有可能会形成从上游到下游的价格水平传导，进而推升 CPI。因此，三季度甚至四季度仍可能是重要的金融降杠杆时间窗，货币政策可能不会边际收紧但大幅放松的可能性很小。在此情况下，股票市场对短期估值水平看似偏低的蓝筹品种的偏好度可能会维持甚至加强，对周期板块的追捧热情仍可能较高，但其中蕴含的风险将逐步加大。一方面，很多蓝筹品种代表着旧经济中的落后供给，在技术进步短期停滞与供给面短期修复的共振效应下，这些标的在业绩上呈现出快速增长，但这种增长可能难以持续太长时间；另一方面，趋势一旦形成，趋势中的受益者会主动或被动地吸附更多的增量资金、进而再配置进来，从而导致趋势的自我强化，甚至是如 2007 年和 2015 年股市见顶前那种脱离基本面的自我强化。在这样的市场中，我们既要尊重市场的运行规律和运行特征，也要努力屏蔽市场情绪对自身投资操作的影响，从衣食住行的消费特征变革、医药产业与养老产业的供需两方面变化、娱乐与教育的行业进步等视角出发，坚持从行业和公司的基本面着眼进行投资决策。

对于债市，目前的收益率水平已经高于历史平均水平，但收益率本身尚未高到可以忽略其他影响因素而独自反转的能力。在货币政策和监管基调尚未有明显变化前，长久期债券的投资机会尚不明确，但配置中等久期的风险已经显著下降。对于转债，如果供给能够大幅放量，则有望拉低市场整体的转股溢价率，使转债市场重新进入可配置阶段。

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值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，本基金托管人在对新华丰利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，新华丰利债券型证券投资基金的管理人——新华基金管理股份有限公司在新华丰利债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新华丰利债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新华基金管理股份有限公司编制和披露的新华丰利债券型证券投资基金 2017 半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

2017 年 8 月 28 日

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华丰利债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	2,873,324.15	144,708,372.54
结算备付金	26,196.56	753,751.00
存出保证金	39,416.97	16,186.18
交易性金融资产	430,889,133.05	269,458,025.31
其中：股票投资	75,046,148.05	59,957,025.31
基金投资	-	-
债券投资	355,842,985.00	209,501,000.00
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	1,100,000.00	525,900,870.00
应收证券清算款	1,195,170.83	-
应收利息	6,915,917.70	3,343,384.94
应收股利	-	-
应收申购款	2,997.60	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	443,042,156.86	944,180,589.97
负债和所有者权益	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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	62,569,706.14	-
应付证券清算款	1,100,000.00	-
应付赎回款	1,026,369.35	-
应付管理人报酬	242,458.69	559,059.02
应付托管费	69,273.93	159,731.15
应付销售服务费	55,754.85	183,821.57
应付交易费用	142,747.65	53,669.20
应交税费	-	-
应付利息	8,669.19	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	228,487.40	112,950.82
负债合计	65,443,467.20	1,069,231.76
所有者权益：	-	-
实收基金	369,326,998.03	941,528,567.76
未分配利润	8,271,691.63	1,582,790.45
所有者权益合计	377,598,689.66	943,111,358.21
负债和所有者权益总计	443,042,156.86	944,180,589.97

注：本基金于 2016 年 10 月 26 日成立，报告截止日 2017 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值 1.0235 元，基金 A 类份额总额 230,861,652.38 份。本基金 C 类份额净值为 1.0206 元，基金 C 类份额总额 138,465,345.65 份。

6.2 利润表

会计主体：新华丰利债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	14,155,080.18
1.利息收入	8,345,420.38
其中：存款利息收入	456,722.08
债券利息收入	6,870,116.38
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,018,581.92
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,871,390.31
其中：股票投资收益	1,304,332.30
基金投资收益	-

债券投资收益	1,588,728.29
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	978,329.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,894,637.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	43,632.34
减：二、费用	3,918,981.41
1. 管理人报酬	2,107,036.99
2. 托管费	602,010.61
3. 销售服务费	567,703.56
4. 交易费用	240,642.39
5. 利息支出	140,069.28
其中：卖出回购金融资产支出	140,069.28
6. 其他费用	261,518.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	10,236,098.77
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	10,236,098.77

注：本基金于 2016 年 10 月 26 日成立，报告截止日 2017 年 6 月 30 日未满一年

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华丰利债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	941,528,567.76	1,582,790.45	943,111,358.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,236,098.77	10,236,098.77
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）	-572,201,569.73	-3,547,197.59	-575,748,767.32
其中：1.基金申购款	2,217,329.47	18,600.28	2,235,929.75
2.基金赎回款	-574,418,899.20	-3,565,797.87	-577,984,697.07
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）	369,326,998.03	8,271,691.63	377,598,689.66

注：本基金于 2016 年 10 月 26 日成立，报告截止日 2017 年 6 月 30 日未满一年。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华丰利债券型证券投资基金(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[2016]1810号文核准，由新华基金管理股份有限公司作为管理人，于 2016 年 9 月 19 日至 2016 年 10 月 21 日向社会公开募集，设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计 941,528,567.76 份，有效认购户数为 5632 户，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2016]01360073 号验资报告予以验证。2016 年 10 月 26 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证券投资基金，存续期不设定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新华丰利债券型证券投资基金招募说明书》及《新华丰利债券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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债、短期融资券、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金各类资产的投资比例范围为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；现金或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%。对股票、权证等权益类资产投资比例不超过基金资产的 20%，其中，权证投资占基金资产净值比例为 0-3%。

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 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 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》、《新华丰利债券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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的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的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 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估计与会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
恒泰证券股份有限 公司	28,534,826.79	17.40%

注：本基金于 2016 年 10 月 26 日成立，报告截止日 2017 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金于 2016 年 10 月 26 日基金合同生效，本报告期本基金未于关联方进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
恒泰证券股份有限公 司	2,207,776.88	4.52%

注：本基金于 2016 年 10 月 26 日成立，报告截止日 2017 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券股份有限公 司	22,200,000.00	35.75%

注：本基金于 2016 年 10 月 26 日成立，报告截止日 2017 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	20,867.64	14.68%	10,511.53	8.12%

注：本基金于 2016 年 10 月 26 日成立，报告截止日 2017 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,107,036.99
其中：支付销售机构的客户维护费	1,508,653.43

注：1、本基金于 2016 年 10 月 26 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

2、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 的年费率每日计提确认，累计至每月月底，按月支付。

3、其计算公式为：日管理人报酬=前一日资产净值×0.7%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	602,010.61

注：1、本基金于 2016 年 10 月 26 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率每日计提确认，累计至每月月底，按月支付。

3、其计算公式为：日托管人报酬=前一日资产净值×0.2%/当年天数。

6.4.8.2.3 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 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华丰利债券 A	新华丰利债券 C	合计
新华基金管理股份有限公司	-	39.82	39.82
恒泰证券股份有限公司	-	11,247.87	11,247.87

中国工商银行股份有 限公司	-	547,222.22	547,222.22
合计	-	558,509.91	558,509.91

注：1、本基金于 2016 年 10 月 26 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

2、本基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.4% 的年费率每日计提确认，累计至每月月底，按月支付。

3、其计算公式为：日 C 类销售服务费=前一日 C 类资产净值×0.4%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于 2016 年 10 月 26 日基金合同生效，本报告期本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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

报告期内基金管理人之外的其它关联方未发生投资本基金的情况。

6.4.8.5 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	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有 限公司	2,873,324.15	39,089.23

注：本基金于 2016 年 10 月 26 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金从事银行间市场债券正回购形成的卖出回购金融资产款余额为 62,569,706.14 元，于 2017 年 7 月 3 日全部到期。该类交易要求基金转入质押库的债券，按银行间市场所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
011698274	16 陕延油 SCP005	2017-07-03	100.18	150,000.00	15,027,000.00
011698985	16 华侨城 SCP006	2017-07-03	100.29	300,000.00	30,087,000.00
011754008	17 豫投资 SCP001	2017-07-03	100.09	190,000.00	19,017,100.00
合计				640,000.00	64,131,100.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

7 投资组合报告

7.1 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	75,046,148.05	16.94
	其中：股票	75,046,148.05	16.94
2	固定收益投资	355,842,985.00	80.32
	其中：债券	355,842,985.00	80.32
	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	1,100,000.00	0.25
	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	2,899,520.71	0.65
7	其他各项资产	8,153,503.10	1.84
8	合计	443,042,156.86	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
C	制造业	43,093,662.93	11.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,210,980.00	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,400.00	0.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	22,897,221.12	6.06
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	355,884.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	75,046,148.05	19.87

7.3 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	002332	仙琚制药	1,556,000	13,381,600.00	3.54
2	002285	世联行	1,405,706	11,273,762.12	2.99
3	600048	保利地产	864,700	8,621,059.00	2.28
4	600521	华海药业	305,995	6,438,134.80	1.71
5	300436	广生堂	125,024	4,702,152.64	1.25
6	000028	国药一致	52,200	4,222,980.00	1.12
7	002422	科伦药业	222,500	3,675,700.00	0.97
8	600867	通化东宝	179,425	3,272,712.00	0.87
9	000732	泰禾集团	180,000	3,002,400.00	0.80
10	300003	乐普医疗	133,000	2,940,630.00	0.78

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站 www.ncfund.com.cn 的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002285	世联行	24,144,726.64	2.56
2	002332	仙琚制药	16,084,149.35	1.71
3	600521	华海药业	7,706,943.60	0.82
4	600048	保利地产	6,875,919.00	0.73
5	600062	华润双鹤	5,990,127.75	0.64
6	300436	广生堂	5,523,248.90	0.59
7	000028	国药一致	4,124,243.47	0.44
8	600867	通化东宝	4,070,456.00	0.43
9	000732	泰禾集团	3,475,258.00	0.37
10	600079	人福医药	2,895,312.00	0.31
11	300003	乐普医疗	2,300,407.64	0.24
12	000963	华东医药	1,492,940.00	0.16
13	002001	新和成	961,500.00	0.10
14	002399	海普瑞	920,998.00	0.10
15	600267	海正药业	905,760.00	0.10
16	600266	北京城建	671,500.00	0.07
17	002343	慈文传媒	347,668.00	0.04

7.4.2 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	002285	世联行	15,384,342.28	1.63
2	601588	北辰实业	14,834,188.23	1.57
3	600030	中信证券	13,000,138.00	1.38
4	601336	新华保险	9,019,257.00	0.96
5	600062	华润双鹤	5,803,717.00	0.62
6	000797	中国武夷	4,424,122.52	0.47
7	600048	保利地产	2,303,300.00	0.24
8	600196	复星医药	1,953,762.00	0.21
9	002332	仙琚制药	1,855,089.00	0.20
10	001979	招商蛇口	1,475,303.76	0.16
11	002399	海普瑞	1,065,036.00	0.11
12	600521	华海药业	993,119.00	0.11
13	600266	北京城建	885,500.00	0.09
14	600867	通化东宝	756,756.23	0.08
15	000028	国药一致	546,799.00	0.06
16	600079	人福医药	504,094.90	0.05
17	000732	泰禾集团	363,000.00	0.04
18	600267	海正药业	337,500.00	0.04

7.4.3 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	88,491,158.35
卖出股票的收入（成交）总额	75,505,024.92

7.5 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	85,603,000.00	22.67
	其中：政策性金融债	85,603,000.00	22.67
4	企业债券	69,722,985.00	18.46

5	企业短期融资券	200,517,000.00	53.10
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	355,842,985.00	94.24

7.6 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	160210	16 国开 10	400,000	36,756,000.00	9.73
2	011698985	16 华侨城 SCP006	300,000	30,087,000.00	7.97
3	011761004	17 中普天 SCP001	300,000	30,087,000.00	7.97
4	011754008	17 豫投资 SCP001	300,000	30,027,000.00	7.95
5	150218	15 国开 18	300,000	28,845,000.00	7.64

7.7 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投资。

7.8 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。

7.9 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投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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备选股票库。

7.12.3 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	39,416.97
2	应收证券清算款	1,195,170.83
3	应收股利	-
4	应收利息	6,915,917.70
5	应收申购款	2,997.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,153,503.10

7.12.4 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转股期的可转换债券。

7.12.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金本报告期前十名股票不存在流通受限的情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
新华丰利债券 A	1,941	118,939.54	0.00	0.00%	230,861,652.38	100.00%
新华丰利债券 C	1,071	129,286.04	0.00	0.00%	138,465,345.65	100.00%
合计	3,012	122,618.53	0.00	0.00%	369,326,998.03	100.00%

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华丰利债券 A	新华丰利债券 C
基金合同生效日（2016 年 10 月 26 日）基金份额总额	399,638,652.08	541,889,915.68
本报告期期初基金份额总额	399,638,652.08	541,889,915.68
本报告期基金总申购份额	775,397.62	1,441,931.85
减：本报告期基金总赎回份额	169,552,397.32	404,866,501.88
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	230,861,652.38	138,465,345.65

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

2017 年 2 月 17 日，林艳芳女士离任本基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理。

本报告期内基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未有基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	37,498,605.00	22.87%	34,922.15	24.56%	-
招商证券	1	31,834,717.66	19.41%	29,647.49	20.85%	-
恒泰证券	2	28,534,826.79	17.40%	20,867.64	14.68%	-
长江证券	1	11,919,584.44	7.27%	11,100.74	7.81%	-
宏源证券	1	11,329,853.40	6.91%	8,285.60	5.83%	-
国泰君安	1	10,844,648.75	6.61%	10,099.65	7.10%	-
中信证券	1	9,625,726.23	5.87%	8,964.44	6.30%	-
方正证券	1	5,676,662.00	3.46%	4,151.32	2.92%	-
华泰证券	1	4,973,688.20	3.03%	3,637.23	2.56%	-
安信证券	1	4,125,239.00	2.52%	3,841.90	2.70%	-
国信证券	1	3,328,197.00	2.03%	3,099.56	2.18%	-
广发证券	1	2,090,739.90	1.27%	1,947.12	1.37%	-
西南证券	1	1,437,574.90	0.88%	1,051.32	0.74%	-
中金证券	1	776,120.00	0.47%	567.58	0.40%	-

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》（证监基金字[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 21 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。

10.7.2 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
海通证券	867,046.15	1.78%	8,600,000.00	13.85%	-	-
恒泰证券	2,207,776.88	4.52%	22,200,000.00	35.75%	-	-
国泰君安	-	-	1,900,000.00	3.06%	-	-
中信证券	43,982,877.52	90.13%	11,600,000.00	18.68%	-	-
国信证券	1,741,467	3.57%	17,800,00	28.66%	-	-

	.02		0.00			
--	-----	--	------	--	--	--

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

二〇一七年八月二十九日