

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金
2017 年半年度报告
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
7.7 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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12 投资组合报告附注.....	38
8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.3 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	39
9 开放式基金份额变动	39
10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	40
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	43
11 影响投资者决策的其他重要信息	44
12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金
基金简称	新华鑫安保本一号混合
基金主代码	519167
交易代码	519167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月18日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,499,500,402.73 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，本基金将主要采用可变比例组合保本策略（VPPI，Variable Proportion Portfolio Insurance）。在保本周期内，基金管理人将严格依据所选择的量化策略模型对固定收益资产和风险资产的配置比例进行动态优化调整，以达到保本和锁定部分收益的目的。同时，本基金管理人将依据与担保人或保本义务人签订的风险管理协议，对基金资产进行严格的风险控制并适时调整投资组合。
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	林葛
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街69 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	北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座F9

邮政编码	400010	100031
法定代表人	陈重	周慕冰

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
登载基金半年度报告正文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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
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）
本期已实现收益	30,728,024.35
本期利润	45,328,962.69
加权平均基金份额本期利润	0.0302
本期加权平均净值利润率	2.96%
本期基金份额净值增长率	2.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	335,630,796.66
期末可供分配基金份额利润	0.2238
期末基金资产净值	1,559,423,176.57
期末基金份额净值	1.040
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.82%

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
过去一个月	0.97%	0.15%	0.31%	0.01%	0.66%	0.14%

过去三个月	1.66%	0.13%	0.94%	0.01%	0.72%	0.12%
过去六个月	2.97%	0.11%	1.88%	0.01%	1.09%	0.10%
过去一年	3.06%	0.11%	3.82%	0.01%	-0.76%	0.10%
过去三年	30.21%	0.33%	14.23%	0.01%	15.98%	0.32%
自基金合同生效起至今	29.82%	0.32%	14.48%	0.01%	15.34%	0.31%

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

新华鑫安保本一号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历史走势对比图
 （2014年6月18日至2017年6月30日）



注：本报告期末本基金各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

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		
赵楠	本基金基金经理，新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理。	2016-05-25	-	5	经济学博士，5 年证券从业经验。2012 年 7 月加入新华基金管理股份有限公司，先后从事宏观研究、策略研究、信用评级，历任新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华安享惠金定

					期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理助理、新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理助理,现任新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券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鑫安保本一号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》、《新华鑫安保本一号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 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理有限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 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现重大异常情况，且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 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，债券市场呈现大幅震荡走势，资金面波动率明显加大，一是由于经济基本面韧性较强，二是美国经济持续走强致使美联储持续加息预期增强，三是央行金融去杠杆防风险政策思路明确。权益市场区间内大幅震荡，传统白马及各行业龙头个股有较好的相对收益。

本报告期内，本基金继续以审慎操作积累安全垫为主要思路。债券投资上，以短久期存单进行配置获取稳定持有收益，同时在权益市场大幅波动中及时调整仓位，选择具有相对安全边际的白马股配置，并且参与新股和可转债 IPO 增厚收益，取得了相对较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.04 元，本报告期份额净值增长率为 2.97%，同期比较基准的增长率为 1.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济受益于传统行业盈利持续改善韧性依然较强，同时在全球基本面好转的大背景下，叠加监管政策取向，货币政策预计维持中性格局。总体来看，债券市场中后期出现趋势性下行的概率较小。但各类债券收益率已经回到历史中位数附近水平，中短久期债券绝对收益率水平有一定配置价值，固收仓位适度提高久期到中性水平。

权益市场也受益于内外部基本面整体改善，未来整体略偏乐观。其中行业基本面维持高景气且估值未显著泡沫化的传统白马及各行业龙头，在 A 股国际化的大背景下，预计在中长期依旧有良好的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、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。

二、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。

三、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。

四、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。

五、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

本报告期内，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况。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严

格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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:新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

报告截止日:2017年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	186,404,092.79	303,249,064.39
结算备付金		1,774,931.59	1,391,010.71
存出保证金		252,492.09	209,602.18
交易性金融资产	6.4.7.2	1,103,556,954.04	908,046,030.36
其中:股票投资		244,466,225.04	168,547,012.06
基金投资		-	-
债券投资		859,090,729.00	739,499,018.30
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	6.4.7.3	259,100,624.11	296,750,545.00
应收证券清算款		-	289,308.86
应收利息	6.4.7.4	10,534,739.23	6,067,828.10
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,561,623,833.85	1,516,003,389.60
负债和所有者权益	附注号	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		-	-
应付证券清算款		51,396.80	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		636,162.18	640,937.52
应付托管费		254,464.85	256,375.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.5	1,030,524.58	751,863.17
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	228,108.87	260,000.00
负债合计		2,200,657.28	1,909,175.72
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.7	1,200,810,015.08	1,200,810,015.08
未分配利润	6.4.7.8	358,613,161.49	313,284,198.80
所有者权益合计		1,559,423,176.57	1,514,094,213.88
负债和所有者权益总计		1,561,623,833.85	1,516,003,389.60

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.040 元,基金份额 1,499,500,402.73 份。

6.2 利润表

会计主体：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

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	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		52,832,079.36	-19,432,860.18
1.利息收入		28,214,124.02	20,840,873.49
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,391,488.45	92,613.45
债券利息收入		21,696,388.85	18,870,794.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,126,246.72	1,877,465.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,017,017.00	-2,431,048.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	6,933,005.99	-22,820,737.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-346,875.02	19,157,805.11
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	6.4.7.12	3,430,886.03	1,231,884.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	14,600,938.34	-37,842,685.42
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		7,503,116.67	4,351,117.84
1. 管理人报酬		3,799,704.55	2,701,350.41
2. 托管费		1,519,881.85	1,080,540.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.14	1,825,546.21	294,791.79
5. 利息支出		71,720.27	5,045.83
其中：卖出回购金融资产支出		71,720.27	5,045.83
6. 其他费用	6.4.7.15	286,263.79	269,389.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		45,328,962.69	-23,783,978.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		45,328,962.69	-23,783,978.02

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

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）	1,200,810,015.08	313,284,198.80	1,514,094,213.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	45,328,962.69	45,328,962.69
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	1,200,810,015.08	358,613,161.49	1,559,423,176.57

项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	865,033,496.67	248,041,235.69	1,113,074,732.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-23,783,978.02	-23,783,978.02
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）	865,033,496.67	224,257,257.67	1,089,290,754.34

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

新华鑫安保本一号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[2014]351号文件《关于核准新华鑫安保本一号混合型证券投资基金募集的批复》批准，由新华基金管理有限公司作为发起人，于2014年5月26日至6月13日向社会公开募集，首次募集资金总额527,969,641.22元，其中募集资金产生利息203,567.11元，并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2014]37100022号验资报告予以验证。2014年6月18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，存续期不固定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金以定期开放的方式运作，即在基金保本周期内采取封闭式运作（保本周期到期日除外），期间不开放申购、赎回及转换转入转出业务；到期操作期间开放赎回和转换转出业务，不开放申购和转换转入业务；过渡期只可进行过渡期申购，不开放赎回、转换转出业务。

本基金保本周期最长为十八个月，在每一保本周期内均设置该保本周期的目标收益率，在保本周期内，如本基金份额净值累计收益率连续 5 个工作日达到或超过预设目标收益率，则基金管理人将在满足条件之日起 10 个工作日内公告本基金当前保本周期提前到期（提前到期日距离满足条件之日起不超过 20 个工作日），并进入到到期操作期间。到期操作期间截止日次一工作日（含该日）起至下一保本周期开始日前一工作日（含该日）的时间为过渡期，最长不超过 20 个工作日；在过渡期最后一个工作日本基金份额净值折算为 1.000 元。过渡期结束后，本基金将进入下一保本周期，同时重新开始计算下一保本周期的目标收益率。

根据《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金将转型为非保本的股票型证券投资基金，基金名称相应变更为“新华精选低波动股票型证券投资基金”。

根据《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫安保本一号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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包含国债、央票、政策性金融债及所有非国家信用的固定收益类金融工具）、股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证、资产支持证券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的相关规定）。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、政策性金融债、企业债、中小企业私募债券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、短期融资券、中期票据、资产支持证券等）、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；本基金不参与定向增发。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%；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%。在每个到期操作期间的前 3 个月、到期操作期间、过渡期及过渡期的后 3 个月不受前述投资组合比例的限制；在到期操作期间和过渡期，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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 2016 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》、《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

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以及经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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最近一期年度报告不一致，所采用的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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税字[2005]107 号文《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、自 2008 年 4 月 24 日起执行的《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起按 0.1% 的税率缴纳。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，将现行的对买卖、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。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	16,404,092.79
定期存款	170,000,000.00
其他存款	-
合计	186,404,092.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	227,645,463.91	244,466,225.04	16,820,761.13	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	21,553,505.21	21,868,729.00	315,223.79
	银行间市场	837,098,030.00	837,222,000.00	123,970.00
	合计	858,651,535.21	859,090,729.00	439,193.79

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,086,296,999.12	1,103,556,954.04	17,259,954.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金报告期无金融衍生工具投资。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行买市场	208,220,624.11	-
固收平市场	50,880,000.00	-
合计	259,100,624.11	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期无买断式逆回购。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	4,728.68
应收定期存款利息	238,027.84
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	821.07
应收债券利息	10,178,469.86
应收买入返售证券利息	112,691.78
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	10,534,739.23

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	998,702.68
银行间市场应付交易费用	31,821.90
合计	1,030,524.58

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 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	228,108.87
合计	228,108.87

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,499,500,402.73	1,200,810,015.08
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,499,500,402.73	1,200,810,015.08

注：本基金本报告期处于封闭期无申赎。

6.4.7.9 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	304,902,772.31	8,381,426.49	313,284,198.80
本期利润	30,728,024.35	14,600,938.34	45,328,962.69
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	335,630,796.66	22,982,364.83	358,613,161.49

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	95,700.73
定期存款利息收入	2,284,111.07
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,676.65
其他	-
合计	2,391,488.45

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	619,678,221.25
减：卖出股票成本总额	612,745,215.26
买卖股票差价收入	6,933,005.99

6.4.7.12 基金投资收益

本基金报告期末投资其它基金。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,605,986,335.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,583,820,884.24
减：应收利息总额	22,512,326.42
买卖债券差价收入	-346,875.02

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金报告期无资产支持证券投资。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金报告期无贵金属投资。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金报告期无衍生工具投资。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,430,886.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,430,886.03

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	14,600,938.34
——股票投资	13,621,304.23
——债券投资	979,634.11
——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	14,600,938.34

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,822,121.21
银行间市场交易费用	3,425.00
合计	1,825,546.21

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	188,437.29

债券账户维护费	18,000.00
汇划手续费	39,174.92
其他	980.00
合计	286,263.79

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
恒泰证券	8,968,954.82	0.69%	7,936,374.80	5.52%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未运用关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 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		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
恒泰证券	0.00	0.00%	1,011,691.28	2.32%

6.4.10.1.4 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		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券	-	-	-	-

注：本基金本报告期无在关联方席位交易的债券回购交易。

6.4.10.1.5 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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券	8,335.15	0.77%	8,270.14	0.83%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券	5,803.82	2.81%	86,408.82	21.21%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月

	30日	30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,799,704.55	2,701,350.41
其中：支付销售机构的客户维护费	1,133,035.59	1,061,977.70

注：本基金采取固定及浮动相结合的管理费收取方式。即本基金在保本周期内收取固定管理费，在保本周期到期日收取浮动管理费。

1、本基金的固定管理费按前一日基金资产净值 0.5%年费率计提。固定管理费的计算方法为：每日基金管理费=前一日基金资产净值×0.5%÷当年天数。

2、本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,519,881.85	1,080,540.15

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如：每日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	16,404,092.79	95,700.73	19,419,131.66	83,172.58

6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下中签	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-08-10	网下中签	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-08-03	网下中签	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601088	中国神华	2017-06-02	重大事项	23.49	-	-	658,765.00	13,359,244.91	15,474,389.85	-
000100	TCL集团	2017-04-20	重大资产重组	3.43	2017-07-26	3.72	1,272,500.00	4,525,158.00	4,364,675.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购投资。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 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 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
A-1	93,104.00	33,102,300.00
A-1 以下	-	-
未评级	60,033,000.00	219,614,000.00
合计	60,126,104.00	252,716,300.00

6.4.13.2.2 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 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	21,775,625.00	-
AAA 以下	-	13,288,718.30
未评级	-	-
合计	21,775,625.00	13,288,718.30

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	186,404,092.79	-	-	-	186,404,092.79
结算备付金	1,774,931.59	-	-	-	1,774,931.59
存出保证金	252,492.09	-	-	-	252,492.09
交易性金融资产	859,090,729.00	-	-	244,466,225.04	1,103,556,954.04
买入返售金融资产	259,100,624.11	-	-	-	259,100,624.11
应收利息	-	-	-	10,534,739.23	10,534,739.23
资产总计	1,306,622,869.58	-	-	255,000,964.27	1,561,623,833.85
负债					
应付证券清算款	-	-	-	51,396.80	51,396.80
应付管理人报酬	-	-	-	636,162.18	636,162.18
应付托管费	-	-	-	254,464.85	254,464.85
应付交易费用	-	-	-	1,030,524.58	1,030,524.58
其他负债	-	-	-	228,108.87	228,108.87
负债总计	-	-	-	2,200,657.28	2,200,657.28

利率敏感度缺口	1,306,622,869.58	-	-	252,800,306.99	1,559,423,176.57
上年度末 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	303,249,064.39	-	-	-	303,249,064.39
结算备付金	1,391,010.71	-	-	-	1,391,010.71
存出保证金	209,602.18	-	-	-	209,602.18
交易性金融资产	739,499,018.30	-	-	168,547,012.06	908,046,030.36
买入返售金融资产	-	-	-	296,750,545.00	296,750,545.00
应收证券清算款	-	-	-	289,308.86	289,308.86
应收利息	-	-	-	6,067,828.10	6,067,828.10
资产总计	1,044,348,695.58	-	-	471,654,694.02	1,516,003,389.60
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	640,937.52	640,937.52
应付托管费	-	-	-	256,375.03	256,375.03
应付交易费用	-	-	-	751,863.17	751,863.17
其他负债	-	-	-	260,000.00	260,000.00
负债总计	-	-	-	1,909,175.72	1,909,175.72
利率敏感度缺口	1,044,348,695.58	-	-	469,745,518.30	1,514,094,213.88

6.4.13.4.1.2 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：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	减少约 327	减少约 261
	市场利率下降 25.00 bp	增加约 327	增加约 261

注：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的银行存款、结算备付金、存出保证金和债券类资产做出以上利率风险的敏感性分析

6.4.13.4.2 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.

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016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	244,466,225.04	15.68	168,547,012.06	11.13
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	859,090,729.00	55.09	739,499,018.30	48.84
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,103,556,954.04	70.77	908,046,030.36	59.97

6.4.13.4.3.2 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：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	本基金业绩比较基准上升 1%	增加约 197	增加约 162
	本基金业绩比较基准下降 1%	减少约 197	减少约 162

注：1. 本基金的整体业绩比较基准为（一年期银行定期存款收益率+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。

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	244,466,225.04	15.65
	其中：股票	244,466,225.04	15.65
2	固定收益投资	859,090,729.00	55.01
	其中：债券	859,090,729.00	55.01
	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	259,100,624.11	16.59
	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	188,179,024.38	12.05
7	其他各项资产	10,787,231.32	0.69
8	合计	1,561,623,833.85	100.00

注：因四舍五入，分项与合计项存在尾差。

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	15,474,389.85	0.99
C	制造业	67,887,878.47	4.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,760,207.00	2.42
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	67,454,466.85	4.33
K	房地产业	55,889,282.87	3.58
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	244,466,225.04	15.68

注：因四舍五入，分项和合计项存在尾差。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期无港股通投资股票组合。

7.3 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	600900	长江电力	2,455,150	37,760,207.00	2.42
2	600048	保利地产	3,207,491	31,978,685.27	2.05
3	601939	建设银行	4,587,900	28,215,585.00	1.81
4	001979	招商蛇口	1,119,410	23,910,597.60	1.53
5	600660	福耀玻璃	783,949	20,414,031.96	1.31
6	600036	招商银行	714,835	17,091,704.85	1.10
7	601088	中国神华	658,765	15,474,389.85	0.99
8	601211	国泰君安	689,600	14,143,696.00	0.91
9	000651	格力电器	331,921	13,665,187.57	0.88
10	600519	贵州茅台	27,812	13,123,092.20	0.84
11	000538	云南白药	113,700	10,670,745.00	0.68
12	601601	中国太保	236,300	8,003,481.00	0.51
13	300146	汤臣倍健	336,400	4,622,136.00	0.30
14	000100	TCL 集团	1,272,500	4,364,675.00	0.28
15	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.05
16	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
17	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
18	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
19	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
20	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
21	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
22	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
23	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
24	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
25	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	600048	保利地产	44,512,410.35	2.94
2	600900	长江电力	35,095,145.18	2.32
3	601939	建设银行	28,857,741.19	1.91
4	001979	招商蛇口	27,001,013.61	1.78
5	600660	福耀玻璃	20,239,628.05	1.34
6	601211	国泰君安	17,853,095.96	1.18
7	600863	内蒙华电	17,078,705.03	1.13

8	600036	招商银行	17,058,472.37	1.13
9	600027	华电国际	16,995,831.83	1.12
10	002294	信立泰	15,634,596.00	1.03
11	601766	中国中车	13,999,375.00	0.92
12	601088	中国神华	13,359,244.91	0.88
13	600519	贵州茅台	12,846,301.48	0.85
14	000651	格力电器	12,508,788.00	0.83
15	601601	中国太保	12,166,293.41	0.80
16	000538	云南白药	10,759,540.00	0.71
17	002250	联化科技	9,895,565.85	0.65
18	601668	中国建筑	9,366,584.00	0.62
19	300015	爱尔眼科	9,118,091.74	0.60
20	002419	天虹股份	7,997,741.00	0.53

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。

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	001979	招商蛇口	24,641,845.31	1.63
2	000651	格力电器	18,555,267.35	1.23
3	601669	中国电建	16,689,076.21	1.10
4	601006	大秦铁路	16,434,411.10	1.09
5	002294	信立泰	16,366,794.08	1.08
6	600027	华电国际	16,034,112.04	1.06
7	600863	内蒙华电	15,903,435.38	1.05
8	601336	新华保险	15,349,790.96	1.01
9	600048	保利地产	15,036,909.09	0.99
10	600660	福耀玻璃	15,007,902.24	0.99
11	601766	中国中车	14,178,934.38	0.94
12	601169	北京银行	14,089,046.15	0.93
13	601668	中国建筑	13,768,102.18	0.91
14	000778	新兴铸管	12,879,227.87	0.85
15	601328	交通银行	10,910,766.77	0.72
16	601933	永辉超市	10,398,880.02	0.69
17	601233	桐昆股份	9,222,195.21	0.61
18	300015	爱尔眼科	9,181,733.91	0.61
19	600500	中化国际	9,174,304.26	0.61
20	002250	联化科技	9,076,186.60	0.60

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	675,043,124.01
卖出股票的收入（成交）总额	619,678,221.25

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。

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	13,831,924.70	0.89
5	企业短期融资券	60,033,000.00	3.85
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,036,804.30	0.52
8	同业存单	777,189,000.00	49.84
9	其他	-	-
10	合计	859,090,729.00	55.09

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	111682549	16 包商银行 CD090	1,500,000	143,430,000.00	9.20
2	111780064	17 中原银行 CD135	700,000	68,453,000.00	4.39
3	111795248	17 江苏江	500,000	49,450,000.00	3.17

		南农村商业 银行 CD042			
4	111795722	17 中德住 房储蓄银行 CD031	500,000	49,440,000.00	3.17
5	111799352	17 长沙银 行 CD055	500,000	48,870,000.00	3.13

7.7 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

本基金本报告期无资产支持证券投资。

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

本基金本报告期无权证投资。

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

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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 本基金投资前十名股票中无超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

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	252,492.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,534,739.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,787,231.32

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期无处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	601088	中国神华	15,474,389.85	0.99	重大资产重组

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

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
6,309	237,676.40	479,784,706.05	32.00%	1,019,715,696.68	68.00%

8.2 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	174.06	0.00%

8.3 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。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 6 月 18 日）基金份额总额	527,969,641.22
本报告期期初基金份额总额	1,499,500,402.73
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	1,499,500,402.73

注：本基金本报告期处于封闭期无份额申赎。

10 重大事件揭示

10.1 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。

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。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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

本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期未发生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。

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	
民族证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	278,062,420.01	21.53%	258,959.78	23.80%	-
东方证券	1	105,091,150.38	8.14%	76,851.60	7.06%	-
东兴证券	1	104,537,237.80	8.09%	76,447.76	7.03%	-
国泰君安	1	103,278,460.82	8.00%	96,182.95	8.84%	-

兴业证券	1	89,575,635.30	6.93%	83,421.84	7.67%	-
国金证券	1	86,787,487.18	6.72%	80,824.92	7.43%	-
中金证券	1	84,719,942.75	6.56%	78,899.33	7.25%	-
安信证券	1	74,667,606.53	5.78%	54,603.64	5.02%	-
天风证券	1	73,057,670.49	5.66%	53,426.97	4.91%	-
信达证券	1	55,215,504.47	4.27%	40,379.84	3.71%	-
华泰证券	1	43,423,024.11	3.36%	31,755.40	2.92%	-
华创证券	1	27,250,026.92	2.11%	19,927.95	1.83%	-
东吴证券	1	24,567,741.94	1.90%	17,966.30	1.65%	-
申银万国	1	24,016,686.21	1.86%	22,366.19	2.06%	-
浙商证券	1	21,953,393.57	1.70%	16,054.57	1.48%	-
民生证券	2	21,142,449.27	1.64%	17,356.10	1.60%	-
平安证券	1	16,366,794.08	1.27%	15,242.61	1.40%	-
中信建投	1	16,172,848.23	1.25%	11,827.33	1.09%	-
光大证券	1	14,941,487.62	1.16%	13,915.01	1.28%	-
川财证券	1	14,816,920.77	1.15%	10,835.65	1.00%	-
恒泰证券	2	8,968,954.82	0.69%	8,335.15	0.77%	-
渤海证券	1	2,858,459.11	0.22%	2,090.38	0.19%	-
中信证券	2	130,544.58	0.01%	121.59	0.01%	-
招商证券	1	62,922.92	0.00%	58.60	0.01%	-

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 34 个交易席位，其中报告期内新增 2 个交易席位。新增席位为：东吴证券深圳交易所席位、天风证券深圳交易所席位。

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济商的排名。

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
民族证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	170,347.60	48.76%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	179,025.00	51.24%	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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部分基金增加肯特瑞财富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	2017-01-07
2	新华基金管理股份有限公司关于调整创金启富代销的部分开放式基金申购金额下限的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-01-07
3	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金 2016 年第 4 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	2017-01-20
4	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书（更新）全文	公司网站	2017-01-26
5	新华鑫安保本一号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	2017-01-26
6	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回及最低持有份额的数额限制的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-02-15
7	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	2017-02-18
8	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-03-31
9	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金 2017 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	2017-04-21
10	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-06-16

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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华鑫安保本一号混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华鑫安保本一号混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华鑫安保本一号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《新华鑫安保本一号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) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (十) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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

二〇一七年八月二十九日