新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

2015 年度报告摘要

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十六日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务材料已经审计。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华安享惠金定期债券	
基金主代码	519160	
交易代码	519160	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年11月13日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	226,844,659.95份	
下属分级基金的基金简称	新华安享惠金定期债券A类	新华安享惠金定期债券C类
下属分级基金的交易代码	519160	519161
报告期末下属分级基金的份额总额	199,443,758.68份	27,400,901.27份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为债券型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
投资策略	本基金的投资策略主要包括:期限配置策略、利率预期策略、类属品种配置策略以及证券选择策略。采用定量与定性相结合的研究方法,深入分析市场利率发展方向、期限结构变化趋势、信用主体评级水平以及单个债券的投资价值,积极主动进行类属品种配置及个券选择,谋求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

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	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	利明献
	联系电话	010-88423386	020-38322888
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	helijian@163.com
客户服务电话		4008198866	95508
传真		010-88423310	020-87311722

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2015年		2014年		2013年11月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	新华安享惠金定期债券A类	新华安享惠金定期债券C类	新华安享惠金定期债券A类	新华安享惠金定期债券C类	新华安享惠金定期债券A类	新华安享惠金定期债券C类
本期已实现收益	44,812,256.09	9,649,744.94	44,003,430.67	21,642,453.65	1,164,481.57	578,091.10
本期利润	47,341,711.65	10,178,590.12	44,138,163.68	22,910,656.40	-1,145,690.73	-637,577.75
加权平均基金份额本期利润	0.0642	0.0693	0.2196	0.2740	-0.0080	-0.0084
本期加权平均净值利润率	5.94%	5.53%	20.41%	25.35%	-0.80%	-0.84%
本期基金份额净值增长率	6.22%	5.67%	31.65%	31.12%	-0.80%	-0.80%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
	新华安享惠金定期债券A类	新华安享惠金定期债券C类	新华安享惠金定期债券A类	新华安享惠金定期债券C类	新华安享惠金定期债券A类	新华安享惠金定期债券C类
期末可供分配基金份额利润	0.09	0.08	0.04	0.03	-0.01	-0.01
期末基金资产净值	221,376,086.78	30,124,442.61	797,395,617.01	186,034,804.12	142,340,147.35	74,893,460.51
期末基金份额净值	1.110	1.099	1.045	1.040	0.992	0.992

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

1. 新华安享惠金定期债券A类:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.00%	0.04%	0.70%	0.00%	0.30%	0.04%
过去六个月	2.87%	0.05%	1.49%	0.00%	1.38%	0.05%
过去一年	6.22%	0.06%	3.37%	0.00%	2.85%	0.06%
自基金合同生效起至今	38.72%	0.21%	8.39%	0.00%	30.33%	0.21%

2. 新华安享惠金定期债券C类:

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	0.73%	0.04%	0.70%	0.00%	0.03%	0.04%
过去六个月	2.52%	0.05%	1.49%	0.00%	1.03%	0.05%
过去一年	5.67%	0.06%	3.37%	0.00%	2.30%	0.06%
自基金合同生效起至今	37.45%	0.21%	8.39%	0.00%	29.06%	0.21%

1、本基金债券投资部分的业绩比较基准采用一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

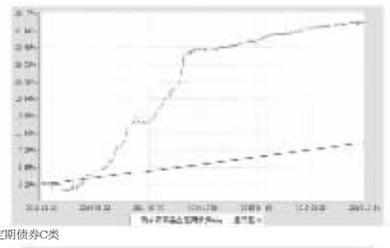
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

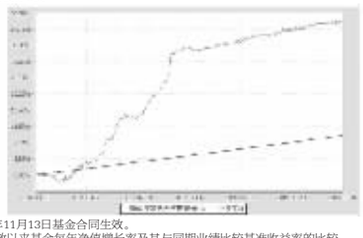
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年11月13日至2015年12月31日)

1、新华安享惠金定期债券A类



2、新华安享惠金定期债券C类



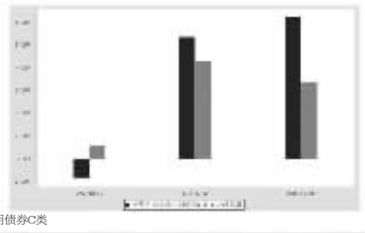
注:本基金于 2013年11月13日基金合同生效。

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

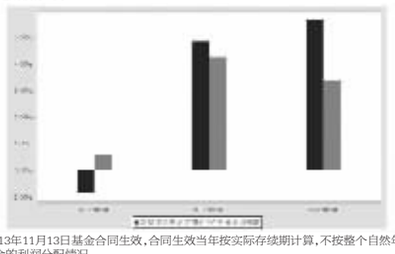
新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、新华安享惠金定期债券A类



2、新华安享惠金定期债券C类



注:本基金于 2013年11月13日基金合同生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、新华安享惠金定期债券A类:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	2.580	35,892,047.61	1,127,298.45	37,019,346.06	-
合计	2.580	35,892,047.61	1,127,298.45	37,019,346.06	-

2、新华安享惠金定期债券C类:

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	2.580	18,140,555.38	1,346,452.61	19,487,007.99	-
合计	2.580	18,140,555.38	1,346,452.61	19,487,007.99	-

注:本基金于 2013年11月13日基金合同生效。

§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2015年12月31日,新华基金管理股份有限公司旗下管理着三十一只开放式基金,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、新华经济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、新华睿诺宝货币市场基金、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、新华财富金30天理财债券型证券投资基金、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和新华积极价值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		
于泽雨	新华基金管理股份有限公司固定收益部总监、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理。	2013-11-13	-	7	经济学博士,7年证券从业经验。历任华安财产保险公司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理,于2012年10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部总监、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理。
赵楠	本基金基金经理助理,固定收益部债券研究员、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。	2015-06-16	-	3	经济学博士,3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,现任固定收益部债券研究员、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。

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

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	新华安享惠金定期债券A类	新华安享惠金定期债券C类
基金合同生效日(2013年11月13日)基金份额总额	143,485,838.08	75,531,038.26
本报告期期初基金份额总额	763,032,038.29	178,871,059.25
本报告期基金总申购份额	62,733,153.46	2,435,393.10
减:本报告期基金总赎回份额	626,321,433.07	153,905,551.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	199,443,758.68	27,400,901.27

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年2月11日,王卫东先生因个人原因不再担任基金管理人副总经理。

2015年11月30日,沈健先生、林艳芳女士担任基金管理人副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,本基金未发生改聘会计师事务所情况。报告年度应支付给其报酬80000元人民币。审计年限为1年。自2013年至2015年,瑞华会计师事务所为本基金连续提供3年审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期,本基金无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	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		
恒泰证券	2	-	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-	-

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3个交易席位,报告期内没有交易席位的变更。

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
恒泰证券	507,662,523.96	100.00%	2,762,400,000.00	100.00%	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期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

二〇一六年三月二十六日

注:1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理股份有限公司作为新华安享惠金定期开放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》、《新华安享惠金定期开放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,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令,交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

基金管理人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

2015上半年债券市场主要呈现区间震荡走势,一方面经济数据显示经济下行压力仍大,货币政策不断发力,资金利率明显下行,推动债券长端收益率出现阶段性下行;但另一方面,随着上半年地方债发行不断推进、股市快速上涨、IPO大规模发行,债市资金出现分流,长端收益率不断反复。2015年下半年,打新资金和配资资金回流债市,经济数据继续表现低迷,市场预期更加悲观,实体经济对资金的吸纳能力大大降低,大量资金的配置需求无法得到满足,推动债券长端收益率不断下行。至年底,10年期国债收益率下降至2.8%附近,10年期国开债收益率下降至3.1%附近。在操作上,虽然收益率整体上震荡下行,但由于收益率水平吸引力有限,本基金在操作上没有敢于主动进攻,而是维持了较低的杠杆比例和久期,主要保持了组合的流动性和收益的稳定性。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金A类份额净值为1.110元,本报告期份额净值增长率为6.22%,同期比较基准的增长率为3.37%;本基金B类份额净值为1.099元,本报告期份额净值增长率为5.67%,同期比较基准的增长率为3.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间,潜在经济增速和通胀中枢的下降以及大量的配置需求决定了利率基本走势,但财政政策的托底作用、美国加息因素以及金融自由化发展下股市等替代资产价格收益变动会增加扰动,收益率的震荡会加大。利率处于历史低位的情况下,进一步大幅下降空间有限,长端利率品应谨慎参与并灵活操作应对波动。目前资金利率稳定,期限走平,信用债维持息差策略,同时警惕信用风险释放背后的流动性问题。择券层面,企业债发行条件放宽,城投企业再融资风险降低,可以适当挖掘中低等级的城投债,寻找新的盈利机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工

4.6.1.1 估值工作小组的职责分工

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

估值工作小组职责:

① 制定估值制度并在必要时修改;

② 确保估值方法符合现行法规;

③ 批准证券估值的步骤和方法;

④ 对异常情况做出决策。

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

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

4.6.1.2 基金会计的职责分工

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

基金会计职责:

① 获得独立、完整的证券价格信息;

② 每日证券估值;

③ 检查价格波动并进行一般准确性评估;

④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动,并在必要时向估值工作小组报告;

⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录;

⑥ 对估值调整和人工估值进行记录;

⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要,可以提议召开估值工作小组会议。

4.6.1.3 投资管理部的职责分工

① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯;

② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告;

④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.6.1.4 交易部的职责分工

① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应;

② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

4.6.1.5监察稽核部的职责分工

① 监督证券的整个估值过程;

② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

③ 确保公司的估值制度和方法符合现行法律、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

报告期内,广发银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金(以下称本基金)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、基金合同、托管协议及其他有关规定,不存在损害计划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,本托管人依照《证券投资基金法》、基金合同、托管协议及其他有关规定,对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督,对本基金资产净值计算、计划资产份额申购赎回价格的计算以及计划费用开支等方面进行了认真地复核,未发现管理人有损害计划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

本报告中的财务指标、投资组合报告等内容数据真实、准确和完整。

广发银行股份有限公司资产托管部

二〇一六年三月十七日

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 张伟 胡慰签字出具了瑞华审字[2016]01360037号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

姓名		
资 产:		
银行存款		
结算备付金		
存出保证金		
交易性金融资产		
其中:股票投资		
基金投资		
债券投资		
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		
应收证券清算款		
应收利息		
应收股利		
应收申购款		
递延所得税资产		
其他资产		
资产总计		
负债和所有者权益		
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		
应付赎回款		
应付管理人报酬		
应付托管费		
应付销售服务费		
应付交易费用		
应交税费		
应付利息		
应付利润		
递延所得税负债		
其他负债		
负债合计		
所有者权益:		
实收基金		
未分配利润		
所有者权益合计		
负债和所有者权益总计		252,521,342.94

注:报告截止日2015年12月31日,A类基金份额净值1.110元,基金份额199,443,758.68份;C类基金份额净值1.099元,基金份额27,400,901.27份。

7.2 利润表

会计主体:新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	68,073,564.67	89,064,117.92
1.利息收入	50,982,399.56	44,997,535.99
其中:存款利息收入	158,171.07	124,612.19
债券利息收入	50,055,732.73	43,489,917.22
资产支持证券利息收入	-	372,934.24
买入返售金融资产收入	768,495.76	1,010,072.34
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	13,945,860.30	42,344,119.40
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	13,945,860.30	42,326,686.52
资产支持证券投资收益	-	17,432.88
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	3,058,300.74	1,402,935.76
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	87,004.07	319,526.77
减:二、费用	10,553,262.90	22,015,297.84
1. 管理人报酬	6,891,227.13	2,118,068.43
2. 托管费	1,968,922.04	605,162.37
3. 销售服务费	647,678.33	314,673.83
4. 交易费用	23,705.76	7,332.73
5. 利息支出	533,705.64	18,503,149.54
其中:卖出回购金融资产支出	533,705.64	18,503,149.54
6. 其他费用	488,024.00	466,910.94
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	57,520,301.77	67,048,820.08
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	57,520,301.77	67,048,820.08

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	941,903,097.54	41,527,323.59	983,430,421.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	57,520,301.77	57,520,301.77
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)	-715,058,437.59	-74,391,755.92	-789,450,193.51
其中:1.基金申购款	65,168,546.56	6,888,359.73	72,056,906.29
2.基金赎回款	-780,226,984.15	-81,280,115.65	-861,507,099.80
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)	226,844,659.95	24,655,869.44	251,500,529.39
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	219,016,876.34	-1,783,268.48	217,233,607.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	67,048,820.08	67,048,820.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	722,886,221.20	32,768,126.04	755,654,347.24
其中:1.基金申购款	913,555,469.40	40,684,679.04	954,240,148.44
2.基金赎回款	-190,669,248.20	-7,916,553.00	-198,585,801.20
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)	-	-56,506,354.05	-56,506,354.05
五、期末所有者权益(基金净值)	941,903,097.54	41,527,323.59	983,430,421.13

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

新华安享惠金定期开放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[2013] 1141号《关于核准新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金募集的批复》的批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于2013年10月8日至2013年11月8日向社会公开募集的契约型开放式债券型证券投资基金。首次募集资金总额219,016,876.34元,其中募集净认购资金金额218,894,492.23元,募集期银行利息折算基金金额为122,384.11元,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2013]第404A0015号验资报告予以验证。2013年11月13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,存续期为不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为广发银行股份有限公司。

本基金的封闭期为自《基金合同》生效之日起(包括《基金合同》生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金的首个封闭期为自《基金合同》生效之日起(包括《基金合同》生效之日)一年的期间。第二个封闭期为首个开放期结束之日次日起(包括该日)的一年,以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。本基金办理申购与赎回业务的开放期为本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起的5至20个工作日。

本基金将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用,但对在同一开放期内申购后又赎回的本类别基金份额收取赎回费的基金份额,称为 C 类基金份额。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别,但不同基金份额类别之间不得相互转换。

根据《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、公司债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具,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)。本基金不参与一级市场新股申购或增发新股,也不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,本基金可参与一级市场及二级市场可转换债券的投资,因持有可转债转股所形成的股票以及因投资可分离债券而产生的权证将于30个工作日内卖出.本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%,但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%。在开放期,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受该比例的限制。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于2016年3月25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》、《新华安享惠金定期开放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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相不一致,所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的要求,自2015年3月30日起,本基金对交易所市场上市交易或挂牌转让的除实行全价交易的可转换债券和深交所可交换债券、按成本法估值的私募债和未上市债券品种以外的固定收益品种估值时,由原来的直接采用交易所收盘价估值变更为第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

7.4.5.3 差错更正的