

基金管理人:新华基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一五年三月二十七日

\$ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事会对本报告的数据表示不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实、准确性、完整性和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，并由董事签名签发。

基金托管人:中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、报告期末基金资产配置等内容,保证复核后的内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实守信、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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摘要。

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,应阅读年度报告全文。

本报告期自2014年6月18日起至2014年12月31日止。

\$ 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

基金代码 519167

交易代码 519167

基金运作方式 约定开放式

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

报告期末基金总资产 440,924,537.45元

2.2 基金产品说明

投资目标 融合运用投资组合保险策略,严格控制风险,在为投资者提供资金安全保证的基础上力争实现基金资产的增值。

投资策略 在投资策略方面,本基金主要采用类固定摊还保本策略 (PPPI, Variable Prepayment Product), 即通过定期赎回部分资产并运用资产配置策略, 在保证本金安全的前提下, 力争实现基金资产收益的最大化。

投资范围 本基金的投资对象是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)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、可转债、分离交易可转换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、商品期货、期权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。

业绩比较基准 一年期定期存款利率(税后)+1%。

风险收益特征 本基金为积极型的保本混合基金, 属于证券投资基金中的低风险品种, 其长期平均预期收益率与同期银行定期存款利率相类似, 并力求在保证本金安全的前提下实现基金资产的增值。

2.3 基金管理人和基金托管人

基金管理人 新华基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

报告期末基金总负债 440,924,537.45元

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址: www.nicfund.com.cn

基金半年度报告备置地点: 新华基金管理有限公司办公地址

咨询电话 010-88423310

客户服务电话 4008198666

传真 010-63208186

2.5 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

2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日

本期实现收益 77,582,524.44

本期利润 79,493,166.38

加权平均基金份额本期利润 0.1557

3.1.2 利润和亏损

2014年末

本期利润增长率为 15.40%

3.1.3 期末可供分配基金份额余额 0.15

3.1.4 期末基金净值 509,009,712.59

3.1.5 期末可供分配基金份额余额 1,154

注:1.本期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个人认购或申购基金时产生的各项费用(例如基金申购赎回费等), 计入本期利润的金额未扣除申购赎回费用, 采用未分配利润和未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期期初余额)。

4.本基金于2014年6月18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计算。

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

注:1.本基金业绩比较基准采用一年期银行定期存款后收益率+1%)\*15%。

2.本基金对业绩比较基准采用每一年平均的计算方法。

3.2.2 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比较

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金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

(2014年6月18日至2014年12月31日)

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金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

(2014年6月18日至2014年12月31日)

注:1.本基金于2014年6月18日成立, 至2014年12月31日未满一年。

2.本基金建仓期为6个月, 建仓完成后本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合比例限制。

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

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金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

(2014年6月18日至2014年12月31日)

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金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

(2014年6月18日至2014年12月31日)

注:1.本基金于2014年6月18日成立, 报告截止日2014年12月31日未满一年, 基金份额净值 1.154元, 基金份额累计 40,924,537.45份。

2.2.1 利润表

会 计 体 制: 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同生效日至2014年12月31日

本报告期: 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日

本期末

资产:

银行存款 62,843,599.31

结算备付金 29,257,650.77

库存现金 118,028.45

交易性金融资产 263,315,992.98

其中:股票投资

债券投资 263,315,992.98

贵金属投资

衍生工具 7,372,488.94

应收款项 34,133,038.64

递延所得税资产 -

其他资产 56,761.39

负债:

应付管理人报酬 167,000,000.00

应付托管费 42,103.07

应付审计费 5,210.64

应付信息披露费 -

应付交易费用 84,309.22

应付申购款 11,301,617.26

应付赎回费 11,301,617.26

应付手续费 291,085.73

应付佣金 79,493,166.38

应付利息 79,493,166.38

应付股利 440,924,537.45

应付税金 68,085,175.14

应付费用 509,009,712.59

应付利息 564,040,787.09

3.2.2 利润表

会 计 体 制: 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同生效日至2014年12月31日

本报告期: 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日

本期末

收入:

利息收入 96,155,893.25

投资收益 27,631,881.99

公允价值变动收益 251,356.49

汇兑损益 -

手续费及佣金收入 10,076,062.49

其他收入 -

投资损失 -

公允价值变动损失 -7,344,637.94

汇兑损失 -

手续费及佣金损失 -4,433,945.37

其他损失 -551,687.29

支出:

利息支出 16,662,726.87

投资损失 4,433,945.37

公允价值变动损失 -5,776,672.31

汇兑损失 -445,842,149.75

手续费及佣金支出 -440,924,537.45

其他支出 -68,085,175.14

税金及附加 -509,009,712.59

3.2.3 所有者权益变动表

会 计 体 制: 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同生效日至2014年12月31日

本报告期: 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日

本期末

所有者权益合计

实收基金 527,969,641.22

未分配利润 -

所有者权益总计 527,969,641.22

3.2.4 基金利润表

会 计 体 制: 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同生效日至2014年12月31日

本报告期: 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日

本期末

净利润 527,969,641.22

未分配利润 -

所有者权益总计 527,969,641.22