新华阿里一号保本混合型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年八月二十六日

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。本半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2015年8月24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2015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	新华阿里一号保本混合
基金主代码	000610
交易代码	000610
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2014年4月25日
基金管理人	新华基金管理有限公司
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	560,099,516.80份
基金合同存续期	不定期

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	(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	张波
	联系电话	010-88423386	0755-22168073
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	zhangbo7746@pingan.com.cn
客户服务电话		4008198866	95511
传真		010-88423310	0755-82080400

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(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	150,619,788.36
本期利润	122,625,051.36
加权平均基金份额本期利润	0.2189
本期基金份额净值增长率	16.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4086
期末基金资产净值	865,276,736.23
期末基金份额净值	1.545

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

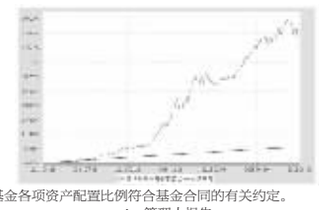
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.91%	0.87%	0.40%	0.00%	0.51%	0.87%
过去三个月	7.67%	0.75%	1.25%	0.00%	6.42%	0.75%
过去六个月	16.52%	0.79%	2.61%	0.00%	13.91%	0.79%
过去一年	52.67%	0.72%	5.59%	0.00%	47.08%	0.72%
自基金合同生效起至今	54.50%	0.67%	6.70%	0.00%	47.80%	0.67%

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

新华阿里一号保本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4月25日至2015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6月30日,新华基金管理有限公司旗下管理着28只开放式基金,即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业股票型证券投资基金、新华行业周期轮换股票型证券投资基金、新华中小市值优选股票型证券投资基金、新华灵活主题股票型证券投资基金、新华优选消费股票型证券投资基金、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、新华趋势领航股票型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华信用增益债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、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。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
姚秋	本基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理、新华财富金30天理财债券型证券投资基金基金经理、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。	2014-07-18	-	2	经济学博士,注册金融分析师,历任于中国建设银行北京分行投资银行部从事投资研究工作、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有限公司。现任新华阿里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、新华财富金30天理财债券型证券投资基金基金经理、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。
孔雪梅	本基金基金经理	2014-04-25	2015-05-20	7	管理学硕士,于2008年3月加入新华基金管理有限公司,负责行业研究。历任新华基金管理有限公司研究部总监、新华优选消费股票型证券投资基金基金经理、新华灵活主题股票型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华阿里一号保本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遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理有限公司作为新华阿里一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》、《新华阿里一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 公平交易制度的执行情况

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,投资指令统一由中央交易室下达,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,中央交易室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,由中央交易室报投资总监、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中央交易室下达投资指令,中央交易室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

2015年初以来,经济数据继续维持低位徘徊,通胀尚无明显抬头迹象。债券收益率短端下行,长端基本维持区间震荡;股票市场估值水平不断抬高,波动加大。具体来看,债券投资方面,我们在情景分析的基础上,继续建立并动态维护以中高等级信用债券为主的低风险债券投资组合,并对久期稍长的信用债进行了适当减仓。转债方面,由于市场上已经找不到符合我们投资标准的标的,因此我们只进行了少量的转债投资并及时获利卖出。股票市场方面,1-5月份,创业板迭创新高、并购重组等题材类个股轮番活跃,报告期结束前,市场遭遇了罕见的杀跌行情,除大金融和石油石化等少数版块较为坚挺外,大部分版块下跌明显。本产品在报告期末也受到了一定的不利影响,但由于持仓以低估值蓝筹为主,损失较小。我们主要关注本身基本面良好、并能够顺应新经济趋势的转型类个股和低估值蓝筹品种,坚决回避单纯靠描绘愿景取悦市场的题材类个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.545元,本报告期份额净值增长率为16.52%,同期比较基准的增长率为2.61%。

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2015年下半年,经济仍未摆脱筑底阶段。通胀在目前位置呈现低位企稳态势,未来受食品价格扰动和大宗商品价格影响,虽然猪肉上涨周期来临,但CPI整体仍不具备趋势性走高条件。国际经济环境未出现明显改善,这为国内货币政策创造了施行空间。下半年,财政政策有可能会加大力度,但这仍然需要宽松货币政策的配合。总体来看,宏观条件对债券市场的的影响仍偏正面。我们对债市继续维持中性偏乐观的判断,在债券投资操作中,我们将在防范信用风险的前提下,继续维持中等组合久期,并密切关注基本面变化对债市的影响,当收益率出现明显走高时,我们将会适度拉长组合久期。转债类资产目前仍处于标的稀缺阶段,存续标的极少,尚无大比例配置价值,为此,我们将等待新转债供给增多后逐渐恢复对转债的投资。对于股票投资,我们将在控制风险的前提下,继续维持一定仓位,在6月底以来的巨幅调整后,坚持从价值角度出发,对标的的选择更加严格,仔细筛选错杀标的进行配置;此外,我们也将继续加强对公司基本面的研究,寻找在新经济中能够脱颖而出的真价值和真成长品种。

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、中央交易室、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 中央交易室的职责分工

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,平安银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对新华阿里一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。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内,由新华基金管理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。

平安银行股份有限公司资产托管部

2015年8月24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:新华阿里一号保本混合型证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	6,717,982.20	86,556,979.03
结算备付金	8,994,261.48	26,079,736.04
存出保证金	426,750.34	433,081.75
交易性金融资产	1,117,436,107.92	1,291,800,838.33
其中:股票投资	202,781,261.98	150,208,031.64
基金投资	-	-
债券投资	914,654,845.94	1,141,592,806.69
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	19,048,928.31	30,975,609.01
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,152,624,030.25	1,435,846,244.16
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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	284,600,000.00	610,800,000.00
应付证券清算款	1,595,407.14	81,286,348.10
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	215,429.67	178,381.18
应付托管费	71,809.90	59,460.40
应付销售服务费	71,809.90	59,460.40
应付交易费用	491,797.07	195,427.70
应交税费	-	-
应付利息	4,165.00	274,167.92
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	296,875.34	341,313.59
负债合计	287,347,294.02	693,194,559.29
所有者权益:	-	-
实收基金	560,099,516.80	560,099,516.80
未分配利润	305,177,219.43	182,552,168.07
所有者权益合计	865,276,736.23	742,651,684.87
负债和所有者权益总计	1,152,624,030.25	1,435,846,244.16

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.545元,基金份额总额560,099,516.80份。

6.2 利润表

会计主体:新华阿里一号保本混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年4月25日(基金合同生效日)至2014年6月30日
一、收入	133,294,108.21	8,875,669.59
1.利息收入	34,545,666.76	7,300,628.60
其中:存款利息收入	180,975.64	326,337.67
债券利息收入	34,342,091.69	6,688,871.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	22,599.43	285,419.22
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	126,743,178.45	623,808.52
其中:股票投资收益	72,388,402.77	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	52,643,153.08	304,409.19
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	1,711,622.60	319,399.33
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-27,994,737.00	951,232.47
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	10,669,056.85	2,122,908.83
1. 管理人报酬	1,196,277.64	304,964.83
2. 托管费	398,759.15	101,654.91
3. 销售服务费	398,759.15	101,654.91
4. 交易费用	617,678.55	10,678.38
5. 利息支出	7,815,774.43	1,511,947.86
其中:卖出回购金融资产支出	7,815,774.43	1,511,947.86
6. 其他费用	241,807.93	92,007.94
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	122,625,051.36	6,752,760.76
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	122,625,051.36	6,752,760.76

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华阿里一号保本混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	560,099,516.80	182,552,168.07	742,651,684.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	122,625,051.36	122,625,051.36
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)	560,099,516.80	305,177,219.43	865,276,736.23
项目	上年度可比期间 2014年4月25日(基金合同生效日)至2014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)	560,099,516.80	-	560,099,516.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,752,760.76	6,752,760.76
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)	560,099,516.80	6,752,760.76	566,852,277.56

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

新华阿里一号证券投资基金(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")证监基金字[2014]334号文件"关于同意新华阿里一号保本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4月10日至4月23日向社会公开募集,首次募集资金总额560,027,900.00元,募集资金产生利息71,616.80元,并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2014]第37100016号验资报告予以验证。2014年4月25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保本混合型证券投资基金,存续期不限定,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《新华阿里一号保本混合型证券投资基金招募说明书》及《新华阿里一号保本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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。本基金股票的投资比例不高于基金资产的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%,在保本期内(保本期到期日除外),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有限公司于2015年8月25日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础,根据实际发生的交易和事项,按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则(以下简称"企业会计准则")、中国证券业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华阿里一号保本混合型证券投资基金合同》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、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

所采用的会计政策与上年度相一致,会计估计与上年度不一致。

6.4.4.1 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。

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

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。

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 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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害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

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

本基金本报告期及上年度可比期间,未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间,未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间,未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间,未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间,未有支付关联方的佣金。

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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年4月25日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,196,277.64	304,964.83
其中:支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注:基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年4月25日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	398,759.15	101,654.91

注:基金的托管人报酬按前一日基金资产净值0.10%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.10%/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 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
新华基金管理有限公司	398,759.15
合计	398,759.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年4月25日(基金合同生效日)至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
新华基金管理有限公司	101,654.91
合计	101,654.91

注:基金的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,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值×0.10%/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

本基金本报告期及上年度可比期间,未通过关联方进行银行间同业市场债券(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

本基金本报告期及上年度可比期间,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期及上年度可比期间,未有除本基金管理人之外的其它关联方投资本基金。

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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年4月25日(基金合同生效日)至2014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
平安银行股份限公司	6,717,982.20	68,647.85	5,158,911.29	58,370.19

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(2015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

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1受限证券类别:债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
132002	15天集EB	2015-06-11	2015-07-02	网下分销	99.99	99.99	7,010.00	700,938.54	700,938.54	-

6.4.9.2 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
000024	招商地产	2015-04-03	筹划重大资产重组	36.50	-	-	700,600.00	9,047,925.60	25,571,900.00	-

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

本报告期末本基金未持有银行间市场正回购。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至2015年06月30日,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额284,600,000.00元,2015年7月1日至2015年7月7日之间到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易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。

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	202,781,261.98	17.59
	其中:股票	202,781,261.98	17.59
2	固定收益投资	914,654,845.94	79.35
	其中:债券	914,654,845.94	79.35
	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	15,712,243.68	1.36
7	其他各项资产	19,475,678.65	1.69
8	合计	1,152,624,030.25	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	54,285,130.72	6.27
C	制造业	15,398,183.68	1.78
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	-	-
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	53,819,593.62	6.22
K	房地产业	75,368,777.96