# 新华鑫安保本一号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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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 | 998,791,903.98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 | 010-88423386 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | qiyan@ncfund.com.cn | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 4008198866 | 95599 |
| 传真 | | 010-88423310 | 010-68121816 |

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 | 47,144,396.03 |
| 本期利润 | 61,698,748.44 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0628 |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.26% |
| 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 | 0.1756 |
| 期末基金资产净值 | 1,060,516,126.54 |
| 期末基金份额净值 | 1.062 |

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

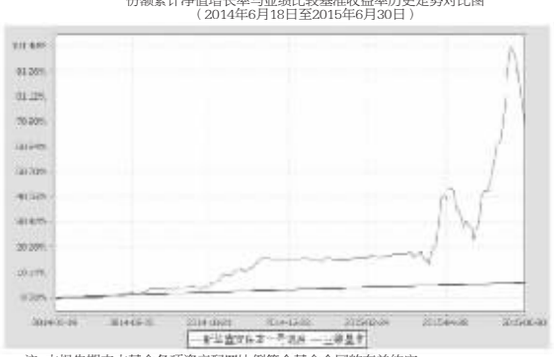
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -0.75% | 1.02% | 0.40% | 0.01% | -1.15% | 1.01% |
| 过去三个月 | 4.02% | 0.77% | 1.20% | 0.01% | 2.82% | 0.76% |
| 过去六个月 | 6.26% | 0.57% | 2.53% | 0.02% | 3.73% | 0.55% |
| 过去一年 | 22.99% | 0.46% | 5.61% | 0.02% | 17.38% | 0.44% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.62% | 0.45% | 5.82% | 0.02% | 16.80% | 0.43% |

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、新华阿里一号保本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。 | 2014-08-07 | - | 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、新华策略精选股票型证券投资基金基金经理、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 贲兴振 | 本基金基金经理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华中小市值优选股票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、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理。 | 2014-06-18 | - | 8 | 经济学硕士,8年证券从业经验。历任北京城市系统工程研究中心研究员。贲兴振先生于2007年9月加入新华基金管理有限公司,先后负责研究煤炭、电力、金融、通信设备、电子和有色金属等行业,担任过策略分析师、债券分析师。现任新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华中小市值优选股票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、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业股票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

本基金成立以来,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。本基金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1.062元,本报告期份额净值增长率为6.26%,同期比较基准的增长率为2.53%。

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,宏观与微观指标的指向性仍不明确。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,这为国内宽松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

4.7.1有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工

4.7.1.1 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。

4.7.1.2 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。

4.7.1.3 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。

4.7.1.4 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周时回应;

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。

4.7.1.5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

本基金本报告期未进行利润分配。

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—新华基金管理有限公司 2015年01月01日至 2015年06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,新华基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

### 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: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 | 5,654,198.01 | 62,843,590.31 |
| 结算备付金 | 15,742,748.28 | 29,257,650.77 |
| 存出保证金 | 199,690.25 | 118,028.45 |
| 交易性金融资产 | 764,996,879.57 | 263,315,992.98 |
| 其中:股票投资 | 288,385,074.17 | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 476,611,805.40 | 263,315,992.98 |
| 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 | 265,800,300.00 | 167,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | 4,563,761.18 | - |
| 应收利息 | 10,141,637.84 | 7,372,488.94 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | 34,133,035.64 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,067,099,215.13 | 564,040,787.09 |
| **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 | - | 7,500,000.00 |
| 应付证券清算款 | 5,219,947.40 | 47,000,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 446,485.18 | 141,903.52 |
| 应付托管费 | 178,594.07 | 56,761.39 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 455,979.27 | 42,103.07 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | 5,210.64 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 282,082.67 | 285,095.88 |
| 负债合计 | 6,583,088.59 | 55,031,074.50 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 865,033,496.67 | 440,924,537.45 |
| 未分配利润 | 195,482,629.87 | 68,085,175.14 |
| 所有者权益合计 | 1,060,516,126.54 | 509,009,712.59 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,067,099,215.13 | 564,040,787.09 |

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.062元,基金份额总额998,791,903.98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: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6月18日(基金合同生效日)至2014年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 65,984,836.95 | -1,542,190.60 |
| 1.利息收入 | 22,091,069.17 | 908,043.89 |
| 其中:存款利息收入 | 255,323.77 | 24,971.57 |
| 债券利息收入 | 18,791,654.98 | 463,002.09 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 3,044,090.42 | 420,070.23 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 29,339,415.37 | - |
| 其中:股票投资收益 | 23,257,214.42 | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 3,682,583.91 | - |
| 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 | 2,399,617.04 | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 14,554,352.41 | -2,450,234.49 |
| 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 | 4,286,088.51 | 140,578.98 |
| 1. 管理人报酬 | 2,435,913.19 | 86,571.47 |
| 2. 托管费 | 974,365.31 | 34,628.59 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 621,031.18 | 365.08 |
| 5. 利息支出 | 3,473.73 | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 3,473.73 | - |
| 6. 其他费用 | 251,305.10 | 19,013.84 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 61,698,748.44 | - |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 61,698,748.44 | -1,682,769.58 |

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: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) | 440,924,537.45 | 68,085,175.14 | 509,009,712.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 61,698,748.44 | 61,698,748.44 |
| 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) | 424,108,959.22 | 65,698,706.29 | 489,807,665.51 |
| 其中:1.基金申购款 | 424,366,861.34 | 65,738,681.12 | 490,105,542.46 |
| 2.基金赎回款 | -257,902.12 | -39,974.83 | -297,876.95 |
| 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 | 195,482,629.87 | 1,060,516,126.54 |

| 项目 | 上年度可比期间 2014年6月18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) | - | - | - |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -1,682,769.58 | -1,682,769.58 |
| 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) | 527,969,641.22 | - | 527,969,641.22 |
| 其中:1.基金申购款 | 527,969,641.22 | - | 527,969,641.22 |
| 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) | 527,969,641.22 | -1,682,769.58 | 526,286,871.64 |

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,开放式资金利息折算份额为0份。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理有限公司,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(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

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)自 2008年 9月 19 日起,基金管理人运用基金买卖股票,交易印花税按单边征收方式,卖出股票按1‰征收,买入股票不征收。

(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 |

6.4.8 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 2015年1月1日至2015年6月30日 | | 上年度可比期间 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014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 | 88,049,512.09 | 17.30% | - | - |

注:本基金上年度可比期间未运用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运用关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | | 上年度可比期间 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014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 | 3,702,284.26 | 0.71% | 47,333,026.50 | 13.19% |

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 2015年1月1日至2015年6月30日 | | 上年度可比期间 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014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 | 4,810,700,000.00 | 32.78% | 849,500,000.00 | 64.38% |

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 2015年1月1日至2015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 | 72,471.55 | 17.48% | 72,471.55 | 15.89% |
| **关联方名称** | **上年度可比期间 2014年6月18日(基金合同生效日)至2014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 | - | - | - | - |

注:本基金上年度可比期间未产生佣金费用。

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6月18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 | 2,435,913.19 | 86,571.47 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 985,385.72 | 27,537.13 |

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资金资产净值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。

6.4.8.2.2 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6月18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 | 974,365.31 | 34,628.59 |

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.

6.4.8.3 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6月18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 |
| 中国农业银行 | 5,654,198.01 | 130,044.01 | 6,236,865.75 | 24,971.57 |

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 | 100.00 | 100.00 | 11,210.00 | 1,121,000.00 | 1,121,000.00 | - |

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