

新华阿里一号保本混合型证券投资基金

[2016] 第四季度报告

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年一月二十日

§1 基金管理人对报告期内本基金运作的有关约定、§4 管理人报告

§2 基金产品概况

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	3,787,000.00	0.44	
C 制造业	6,817,096.17	0.67	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00	
E 建筑业	15,592.23	0.00	
F 批发和零售业	-	-	
G 交通运输、仓储和邮政业	9,459.68	0.00	
H 住宿和餐饮业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	2,996,515.00	0.36	
J 金融业	3,568,790.00	0.41	
K 房地产业	47,573,709.99	5.61	
L 租赁和商务服务业	-	-	
M 科学研究、技术服务业	-	-	
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-	
O 国际贸易、代理和批发零售业	-	-	
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	80,331,464.36	1.00	

§3 投资目标

综合运用投资组合保险策略,严格控制风险,在为投资人提供资金安全保障的同时力争实现基金资产的增值。

§4 投资策略

在投资策略方面,本基金将主要采用固定比例组合保险策略(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)策略模型作为基础,主要

通过动态地调整各类基金在组合中的配置比例,确保基金投资的稳定性(即所谓的“保本”机制),以实现风险与回报的平衡。

§5 报告期末基金的金融资产总额

800,331,464.36元

§6 报告期基金的金融负债总额

1,000,000.00元

§7 报告期期末基金的资产净值

800,330,464.36元

§8 报告期期末基金的份额净值

0.9998元

§9 报告期期末基金的申购赎回费用

0.00%

§10 报告期期末基金的资产净值占总资产的比例(%)

100.00%

§11 报告期期末可供分配基金份额总额

800,330,464.36元

§12 报告期期末可供分配金额

800,330,464.36元

§13 报告期期末可供分配基金份额的单位净值

0.9998元

§14 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额

0.00元

§15 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§16 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占期末基金资产净值的比例(%)

0.00%

§17 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§18 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§19 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§20 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§21 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§22 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§23 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§24 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§25 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§26 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§27 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§28 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§29 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§30 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§31 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§32 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§33 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§34 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§35 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§36 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§37 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§38 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§39 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§40 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§41 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§42 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§43 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§44 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§45 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§46 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§47 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§48 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§49 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§50 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§51 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§52 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§53 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§54 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§55 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§56 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§57 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§58 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§59 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§60 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§61 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§62 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§63 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§64 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§65 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§66 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§67 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

§68 报告期期末可供分配金额与期末基金资产净值的差额占可供分配金额的比例(%)

0.00%

</