

新华优选消费股票型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

息、红利暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。
(4) 本基金买卖股票于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,将现行对买入、卖出、赠与所书立的A股、B股股权转让书据按0.1%的税率对买方单边征收证券(股票)交易印花税,调整为双边征收,即以“买入”为准,双边书立的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) 本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
本报告期内,本基金不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。
6.4.7.2 本报告期本基金关联交易各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人

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
本基金本报告期无通过关联方交易单元进行股票交易。
6.4.8.1.2 债券交易
本基金本报告期无通过关联方交易单元进行权证交易。
6.4.8.1.3 债券回购交易
本基金本报告期无通过关联方交易单元进行债券回购交易。
6.4.8.1.4 债券买卖
本基金本报告期无通过关联方交易单元进行债券交易。
6.4.8.1.5 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	上期
当期发生的基金应支付的基金管理费	744,504.00	383,177.35

注:1.本基金于2012年6月13日成立,可比期间无对比数据。
2.基金管理人报酬前一基金资产净值1.5%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月末,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×1.5%/当年天数。
3.本报告期末支付的支付给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	上期
当期发生的基金应支付的托管费	124,059.19	62,029.67

注:1.本基金于2012年6月13日成立,可比期间无对比数据。
2.基金托管费按按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。
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
本报告期末与关联方进行银行间债券(含回购)交易。
6.4.8.4 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
报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。
6.4.8.4.2 报告期内除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况
报告期内,除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。
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	上期
中国工商银行	37,597,453.49	117,597.41

注:本基金于2012年6月13日成立,可比期间无对比数据。
6.4.8.6 本基金在承销期间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(2013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/增发证券于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值价格(元)	数量(股)	期末总市值	期末估值总额	备注
600929	九元电子	2013-06-05	重大资产重组停牌	19.37	17,500	6,000.00	1,014,124.39	1,162,200.00
601886	江印转债	2013-06-20	发行转债停牌	12.20	20,000	257,552.00	244,000.00	-

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
本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。
6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7. 期末基金资产组合情况

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	60,276,910.49	59.34
2	其中:股票	60,276,910.49	59.34
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	38,054,798.57	37.46
9	其他各项资产	3,296,967.47	3.20
10	合计	101,582,705.53	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金总资产比例(%)
A	医药、生物、医药	2,897,150.00	2.87
B	信息技术	36,751,985.65	36.20
C	制造业	6,818,450.00	6.81
D	电力、热力、燃气生产和供应业	876,500.00	0.88
E	建筑业	1,328,750.00	1.33
F	批发和零售业	2,099,219.84	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,910,505.00	1.91
H	住宿和餐饮业	117,700.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,728,200.00	6.72
J	金融业	138,450.00	0.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	批发和零售业	-	-
N	房地产业	-	-
O	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	批发和零售业	-	-
Q	教育	-	-
R	卫生和社会工作	-	-
S	文化、体育和娱乐业	-	-
T	综合	-	-
合计		60,276,910.49	60.24

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000848	保利地产	14,900	3,199,830.00	3.20
2	002557	洽洽食品	186,796	3,173,664.04	3.17
3	300779	数码视讯	150,091	3,145,907.00	3.14
4	002226	江南化工	250,000	2,930,000.00	2.93
5	600028	中国石化	205,252	2,444,219.84	2.44
6	601179	中国国旅	754,600	2,309,076.00	2.31
7	000602	金马集团	160,000	2,128,000.00	2.13
8	300255	药石控股	105,500	1,979,180.00	1.98
9	600699	鲁商置业	180,000	1,963,800.00	1.96
10	002311	伟星新材	80,000	1,757,600.00	1.75

注:本基金于2012年6月13日成立,可比期间无对比数据。
报告期末(2013年6月30日)本基金资产组合情况:
本基金6.4.9.1至6.4.9.4.财务报表由下列负责人签署:
基金管理人:李强,主管会计工作负责人:张宗友,会计机构负责人:徐瑞峰
6.4.6 税项
6.4.1 基金基本情况
新华优选消费股票型证券投资基金(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[2011]1948号文核准,由新华基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”)于2012年5月11日至2012年6月8日公开发售募集,设立日期期间募集及后续结转的资金份额共计1,669,094,571.07份,有效认购户数为3,538户,并经国富华会计师事务所有限公司清验华会[2012]004466号验资报告予以验证,2012年6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,存续期限不限,本基金管理人为新华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。
根据《新华优选消费股票型证券投资基金招募说明书》及《新华优选消费股票型证券投资基金合同》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股票、债券、资产支持证券、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产占基金资产的比重范围为0—95%,其中投资于消费行业股票的比例不低于基金资产净值的80%,投资于本基金资产的比重范围为0—40%,资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为0—20%,权证投资占基金资产净值的比例范围为0—3%,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%。如法律法规和中国证监会变更上述投资、资产支持证券投资的比例限制,基金管理人可相应调整投资组合中各类资产的投资比例,但须符合中国证监会有关基金投资品种的规定,基金管理人应在调整投资组合后,可以及时将调入、本基金投资组合。
本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理公司于2013年8月28日批准报出。
6.4.2 会计报表编制基础
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2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华优选消费股票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有关基金业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 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保持一致的说明
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保持一致。
6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
6.4.6 本报告期未发生会计政策变更。
6.4.5.2 会计估计变更的说明
本基金本报告期未发生会计估计变更。
6.4.5.3 差错更正的说明
本基金本报告期未发生差错更正。
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问题的通知》、财税[2005]111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《关于股权转让个人所得税改革有关征管问题的通知》、国税发[2005]107号文《关于利息红利个人所得税的补充通知》,自2008年4月24日起执行的《关于调整证券(股票)交易印花税征收方式的通知》及相关法律法规规定,本基金适用如下:
(1) 以发行基金方式募集资金,不属于征收印花税范围,不征收印花税。
(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收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;对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金派发

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年八月二十八日

1 重要提示及目录

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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22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预示其未来表现,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。
本报告中财务数据未经审计。
本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况

基金名称	新华优选消费股票型证券投资基金
基金代码	919150
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6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	中国工商银行股份有限公司
报告期内基金净值增长率	82.286,490.21%

2.2 基金产品说明

投资目标
精选消费行业中具有持续增长潜力的优质上市公司进行投资,在风险可控的前提下追求基金资产的持续、稳定增长。
本基金主要通过定性分析和定量分析两个方面进行股票投资。
业绩比较基准
80%×中证内地消费主题指数收益率+20%×上证国债指数收益率。
风险收益特征
本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的高风险高收益品种,预期风险和收益均高于混合型基金、债券型基金和货币型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

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	中国工商银行股份有限公司
法定代表人	齐彬	赵会军
信息披露负责人	联系电话: 010-88423386 电子邮箱: qian@xfund.com	010-66105799 custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4008198866	95588
传真	010-88423310	010-66109004

2.4 信息披露方式

信息披露半年度报告正文的查阅及网络网址	www.xfund.com
基金半年度报告备查地点	新华基金管理股份有限公司办公处

3 主要财务数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期末(2013年1月1日至2013年6月30日)	金额单位:人民币元
本期已实现收益	21,634,101.58	
本期利润	10,974,115.90	
加权平均基金份额本期利润	0.1322	
本期基金份额净值增长率	13.97%	
3.1.2 年度数据和指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.2159	
期末基金份额净值	100.053,272.32	
期末基金份额净值	1.216	

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(例如基金申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.本期期末可供分配利润,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)。

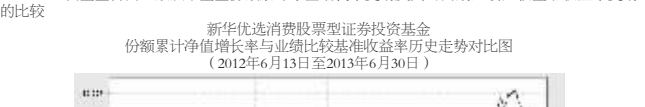
3.2 基金净值表现

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

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③	④
过去一个月	-4.96%	0.96%	-4.02%	1.31%	1.06%
过去三个月	2.96%	0.89%	-2.76%	1.01%	5.72%
过去六个月	11.97%	1.04%	-4.09%	0.97%	16.06%
过去一年	21.12%	0.78%	-7.27%	0.95%	28.39%
自基金成立起至今	21.60%	0.76%	-8.75%	0.95%	30.35%

注:1.本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中证内地消费主题指数、债券投资部分的业绩比较基准选择上证指数指数,复合业绩比较基准为:80%×中证内地消费主题指数收益率+20%×上证指数指数收益率。
2.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业绩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

新华优选消费股票型证券投资基金
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
(2012年6月13日至2013年6月30日)



注:1.本基金于2012年6月13日基金合同生效;
2.本基金合同生效6个月,建仓结束时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的比例范围。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金基本情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
新华基金管理有限责任公司经中国证监会基金管理委员会批准,于2004年12月9日注册成立,注册地为重庆市,是我国首家基金管理公司。
截至2013年6月30日,新华基金管理有限公司旗下管理着十只开放式基金,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、新华优选资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华优选品质企业股票型证券投资基金、新华行业周期轮动策略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、新华纯债回报灵活配置证券投资基金和新华行业轮动策略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期间	说明
李强	本基金基金经理、新华优选成长股票型证券投资基金基金经理、新华行业周期轮动策略股票型证券投资基金基金经理、新华行业轮动策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华行业轮动策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-06-13	18

注:1.新任基金经理,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.曾任本基金经理,任职日期指自任职公告作出决定之日。
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优选消费股票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》、《新华优选消费股票型证券投资基金基金合同》以及其他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收益,运作符合基金合同、托管协议和相关法律法规的要求,不存在损害基金份额持有人利益的行为。
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《新华基金管理公司公平交易管理制度》,制度内容包括场内上市股票、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,严格控制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,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申购条件的数量进行比例分配;如有异议,由中央交易室报投资决策委员会、督察长、金融工程部和合规稽核部,做出仲裁并确定最终分配结果,如被督察长认为有必要,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、固定收益资产、交易所大宗交易,投资组合之间由中央交易室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所申购、交易确认,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,公司不同组合在不同时间段的多个交易日进行了溢价率不同的采集,通过溢价溢价率、买入/卖出溢价率以及利差溢价率等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时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金额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
2013年上半年股市场结构差异较大,以TMT、医药、环保为代表的成长股,创业板涨幅很大,而权重股表现平平,甚至下跌,本基金在年初以来择时上,有效规避了前期重仓创业板个股,整体业绩表现跑赢大盘,甚至超越大盘,本基金依然坚持价值与成长的思路,在成长方面精选个股,同时兼顾行业优选配置策略,力争取得较好的收益。
4.5 管理人对报告期内基金的估值调整等事项的说明
有参与估值调整程序方及人员(小组)的履职分工:
一估值工作小组的履职分工
公司成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 批准估值方法和估值程序;
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或以上多数通过。
基金会计的职责分工:
基金会计负责日常证券资产估值,基金会计和公司资产管理部相互独立,在按照本估值制度和相关法律法规估值后,基金会计定期将证券估值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 估值的价格变动进行一般谨慎性评估;
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 对估值调整和工作估值进行记录;
⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。
基金会计认为有必要,可以提议召开估值工作小组会议。
三投资管理部的履职分工
① 接受监察稽核部对所投资证券资产异常波动的询问;
② 对申购赎回、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向他端认为可能的估值偏差。
四、中央交易室的职责分工:
① 对估值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。

4.2 基金管理人及基金基本情况

4.2.1 基金管理人及其管理基金的经验
新华基金管理有限责任公司经中国证监会基金管理委员会批准,于2004年12月9日注册成立,注册地为重庆市,是我国首家基金管理公司。
截至2013年6月30日,新华基金管理有限公司旗下管理着十只开放式基金,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、新华优选资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华优选品质企业股票型证券投资基金、新华行业周期轮动策略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、新华纯债回报灵活配置证券投资基金和新华行业轮动策略灵活配置混合型证券投资基金。
4.2.2 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期间	说明
李强	本基金基金经理、新华优选成长股票型证券投资基金基金经理、新华行业周期轮动策略股票型证券投资基金基金经理、新华行业轮动策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华行业轮动策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-06-13	18

注:1.新任基金经理,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.曾任本基金经理,任职日期指自任职公告作出决定之日。
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优选消费股票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》、《新华优选消费股票型证券投资基金基金合同》以及其他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收益,运作符合基金合同、托管协议和相关法律法规的要求,不存在损害基金份额持有人利益的行为。
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《新华基金管理公司公平交易管理制度》,制度内容包括场内上市股票、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,严格控制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,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申购条件的数量进行比例分配;如有异议,由中央交易室报投资决策委员会、督察长、金融工程部和合规稽核部,做出仲裁并确定最终分配结果,如被督察长认为有必要,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、固定收益资产、交易所大宗交易,投资组合之间由中央交易室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所申购、交易确认,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,公司不同组合在不同时间段的多个交易日进行了溢价率不同的采集,通过溢价溢价率、买入/卖出溢价率以及利差溢价率等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时段是否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金额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
2013年上半年股市场结构差异较大,以TMT、医药、环保为代表的成长股,创业板涨幅很大,而权重股表现平平,甚至下跌,本基金在年初以来择时上,有效规避了前期重仓创业板个股,整体业绩表现跑赢大盘,甚至超越大盘,本基金依然坚持价值与成长的思路,在成长方面精选个股,同时兼顾行业优选配置策略,力争取得较好的收益。
4.5 管理人对报告期内基金的估值调整等事项的说明
有参与估值调整程序方及人员(小组)的履职分工:
一估值工作小组的履职分工
公司成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 批准估值方法和估值程序;
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或以上多数通过。
基金会计的职责分工:
基金会计负责日常证券资产估值,基金会计和公司资产管理部相互独立,在按照本估值制度和相关法律法规估值后,基金会计定期将证券估值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 估值的价格变动进行一般谨慎性评估;
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 对估值调整和工作估值进行记录;
⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。
基金会计认为有必要,可以提议召开估值工作小组会议。
三投资管理部的履职分工
① 接受监察稽核部对所投资证券资产异常波动的询问;
② 对申购赎回、价格