浙商聚盈信用债债券型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:浙商基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2015年07月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浙商聚盈信用债债券
基金主代码	686868
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年09月18日
报告期末基金份额总额	49,450,639.56份
投资目标	在有效控制风险与保持资产流动性的前提下,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,追求基金资产长期,持续,稳定增值,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,在科学分析与有效管理信用风险的基础上,实现风险与收益的最佳配比。一方面,本基金通过深入分析影响证券市场各个因素的运行趋势及其对证券市场的作用机制,综合分析评判证券市场中债券、股票等各类资产风险收益特征的相对变化,在投资组合比例范围内适时调整债券、股票等资产的配置比例;另一方面,本基金通过久期策略、收益率曲线策略、信用利差曲线策略、信用债个券分析策略、息差套利策略和可转换债券投资策略等固定收益投资策略,以增加投资组合的收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率(全价)
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	浙商基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	浙商聚盈信用债债券A	浙商聚盈信用债债券C
下属两级基金的交易代码	686868	686869
报告期末下属两级基金的份额总额	48,112,780.13份	1,337,859.43份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年04月01日-2015年06月30日)	
	浙商聚盈信用债债券A	浙商聚盈信用债债券C
1.本期已实现收益	1,021,108.67	30,879.34
2.本期利润	1,222,667.31	40,670.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0253	0.0271
4.期末基金资产净值	58,586,287.62	1,611,276.99
5.期末基金份额净值	1.218	1.204

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

浙商聚盈信用债债券A

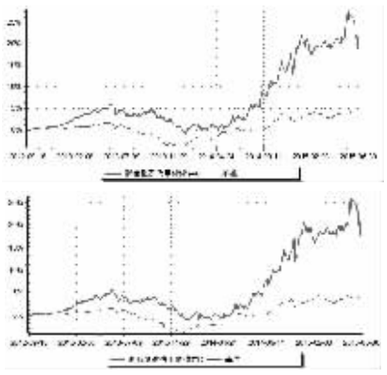
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.18%	0.66%	1.35%	0.10%	0.83%	0.56%

浙商聚盈信用债债券C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	2.03%	0.65%	1.35%	0.10%	0.68%	0.55%

注:本基金业绩比较基准为:中债综合指数收益率(全价)

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:1.本基金基金合同生效日为2012年9月18日,基金合同生效日至本报告期末,本基金生效时间已满一年。
2.本基金建仓期为6个月,从2012年9月18日至2013年3月17日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
洪慧梅	本基金的基金经理、固定收益部副总经理(主持工作)	2012年09月18日	-	9年	洪慧梅女士,同济大学经济与管理学院金融学硕士,历任平安资产管理有限责任公司集中交易部债券交易员,汇丰人寿保险有限责任公司投资管理部交易主任。
莫华寅	本基金的基金经理	2014年09月30日	-	8年	莫华寅先生,CFA,上海外国语大学工商管理硕士,历任中银基金销售与市场部华南区总经理,东吴证券固定收益部高级交易员。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了规范公平交易行为,保护投资者合法权益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规规定,本公司制订了相应的公平交易制度。在投资决策层面,本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,对不同类别的投资组合分别管理、独立决策;在交易层面,实行集中交易制度,建立了公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,严禁在不同投资组合之间进行利益输送;在监控和评估层面,本公司金融工程小组将每日审查当天的投资交易,对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控,同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内,本基金未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内本基金主要投资品种为信用债可转债,本季度管理人基本维持了上季度信用债的投资比例,少量增加了短期品种和高等级债券的投资比例,可转债由于高溢价水平以及个券的逐渐赎回,本组合投资比例降低。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日为止,本基金A类份额净值为1.218元,本报告期内份额净值增长率为2.18%,同期业绩比较基准收益率为1.35%;本基金C类份额净值为1.204元,本报告期内份额净值增长率为2.03%,同期业绩比较基准收益率为1.35%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内曾经在在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满两百人的情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本季度各项宏观经济数据继续放缓,通胀持续走低,预期未来一个季度宏观经济尚不能出现明显的改善。针对经济的持续低迷和通胀的走低,央行连续下调存款准备金率和存贷款利率,同时通过地方政府债务置换降低系统性债务违约风险。债券市场对货币政策的一系列反应相对钝化,主要原因在于供给的冲击以及股票市场的持续大爆分流了债市资金和人气。本基金管理人对短期债券市场走势谨慎乐观。经济基本面以及流动性将支撑债券市场不会出现大幅调整,压力仍来源于供给。从中长期看,降低社会融资成本以及人民币国际化进程的加快需要有深度和广度的债券市场,因此信用债的发展和创新将是未来债券市场发展的方向。存量可转债个券继续减少,溢价率水平仍较高,将重点参与一级市场可转债申购和精选次新转债。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	59,221,077.69	89.24
	其中:债券	59,221,077.69	89.24
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,522,604.87	9.83
8	其他资产	617,500.90	0.93
9	合计	66,361,183.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,943,123.00	3.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	40,253,665.79	66.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	17,024,288.90	28.28
8	其他	-	-
9	合计	59,221,077.69	98.38

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	126018	08江铜债	145,930	14,355,134.10	23.85
2	122068	11海螺01	61,210	6,215,875.50	10.33
3	112138	12苏宁01	60,000	6,102,000.00	10.14
4	113008	电气转债	29,270	5,299,040.80	8.80
5	113501	洛钼转债	37,650	5,249,916.00	8.72

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	24,670.31
2	应收证券清算款	52,212.57
3	应收股利	-
4	应收利息	536,635.91
5	应收申购款	3,982.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	617,500.90

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113501	洛钼转债	5,249,916.00	8.72
2	110030	格力转债	1,921,300.00	3.19
3	128009	歌尔转债	1,217,842.60	2.02
4	113007	吉视转债	543,877.10	0.90

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	浙商聚盈信用债债券A	浙商聚盈信用债债券C
报告期期初基金份额总额	48,636,942.11	1,714,395.00
报告期期间基金总申购份额	282,350.56	167,614.44
减:报告期期间基金总赎回份额	806,512.54	544,150.01
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	48,112,780.13	1,337,859.43

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准浙商聚盈信用债债券型证券投资基金设立的相关文件;
2.《浙商聚盈信用债债券型证券投资基金招募说明书》;
3.《浙商聚盈信用债债券型证券投资基金基金合同》;
4.《浙商聚盈信用债债券型证券投资基金托管协议》;
5.基金管理人业务资格批件和营业执照;
6.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;
7.中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

杭州市西湖区教工路18号世贸丽晶城欧美中心1号楼D区6层606室

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.zsfund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-067-9908/021-60359000查询相关信息。

浙商基金管理有限公司
二〇一五年七月二十日

新华钻石品质企业股票型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华钻石品质企业股票
基金主代码	519093
交易代码	519093
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月3日
报告期末基金份额总额	485,576,898.78份
投资目标	本基金通过对上市公司基本面的深入研究,结合宏观经济周期和行业景气度分析,力求在有效控制风险并适度保持良好流动性的前提下,精选具有稳定价值性和高质量成长性的钻石品质类的优质上市公司。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略,通过对经济周期,行业特征等宏观层面的信息进行全面分析,调整大类资产配置比例和行业配置比例;在个股个券的选择上采用自下而上的投资策略,核心是从企业价值的稳定性和成长的高质量出发,筛选具有钻石品质的优质企业,并进行重点配置。钻石品质企业股票的配置比例不低于股票资产配置的90%。钻石品质企业是指具有稳定价值性和高质量成长性的上市公司,它们具有安全、透明、稳定、创新与领导气质五大优秀品质。
业绩比较基准	80%×沪深300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。
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	617,151,095.99
2.本期利润	251,164,341.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.2783
4.期末基金资产净值	1,104,042,922.99
5.期末基金份额净值	2.274

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。

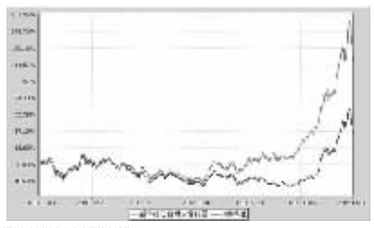
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	9.48%	2.30%	8.86%	2.09%	0.62%	0.21%

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

新华钻石品质企业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
(2010年2月3日至2015年6月30日)



注:报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曹名长	本基金基金经理	2010-02-03	2015-06-09	18	经济学硕士,历任君安证券有限公司研究员、红塔证券股份有限公司资产管理部投资经理、百瑞信托股份有限公司投资经理、新华基金管理有限公司总经理助理、新华优选分红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、新华优选成长股票型证券投资基金基金经理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
资兴振	本基金基金经理、新华鑫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。	2015-06-08	-	8	经济学硕士,8年证券从业经验,历任北京域市系统工程研究中心研究员,资兴振先生于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,现任新华鑫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。

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钻石品质企业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》、《新华钻石品质企业股票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 公平交易专项说明

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,同时包括投权、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,投资指令统一由交易部下达,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,交易部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,由交易部报投资总监、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交易部下达投资指令,交易部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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度后期,清理场外配资引发市场恐慌,市场极速大跌。本基金在二季度考虑到市场结构性泡沫显著,配置上增加了蓝筹股的配置比例,更加注重投资标的安全边际,但净值也有一定的回撤,今后在回避系统性风险上加强前瞻预判能力。

4.5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2.274元,本报告期份额净值增长率为9.48%,同期比较基准的增长率为8.86%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

杠杆危机对投资者的信心有所影响,但随着股票价格的调整,股票估值水平有了很大幅度的回归,很多标的的投资价值显现,本基金将更加注重精选个股,沙中淘金,追求业绩兑现的确定性,争取在第三季度取得好的投资业绩回报投资者的信任。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	971,295,653.09	78.40
	其中:股票	971,295,653.09	78.40
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	264,126,033.62	21.32
7	其他资产	3,476,275.37	0.28
8	合计	1,238,897,962.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	14,635,599.35	1.33
C	制造业	400,208,922.52	36.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,798,065.00	0.98
F	批发和零售业	16,548,147.54	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	3,597,019.92	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,319,260.34	1.12
J	金融业	292,367,223.12	26.48
K	房地产业	198,910,649.22	18.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	21,910,766.08	1.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
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	971,295,653.09	87.98

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,268,805	103,965,881.70	9.42
2	601166	兴业银行	4,857,854	83,797,981.50	7.59
3	000002	万 科A	4,925,245	71,514,557.40	6.48
4	000786	北新建材	3,443,910	65,881,998.30	5.97
5	000024	招商地产	1,342,567	49,003,695.50	4.44
6	600309	万华化学	1,369,418	33,112,527.24	3.00
7	601588	北辰实业	4,298,148	33,095,739.60	3.00
8	600036	招商银行	1,712,318	32,054,592.96	2.90
9	600007	中国国贸	2,046,054	31,161,402.42	2.82
10	601965	中国汽研	1,763,379	22,941,560.79	2.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金尚无股指期货投资政策。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2014年12月8日,中国平安(601318.SH)子公司平安证券因出具的保荐书存在虚假记载被证监会给予警告,并没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2867万元,并处以440万元罚款,除此之外,基金投资前十名证券没有被监管部门立案调查或公开谴责、处罚。

5.11.2本报告期内,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	634,776.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	50,268.20
5	应收申购款	2,791,230.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,476,275.37

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000786	北新建材	65,881,998.30	5.97	重大资产重组,停牌
2	000024	招商地产	49,003,695.50	4.44	重大资产重组,停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	1,937,798,339.14
本报告期期初基金份额总额	1,141,107,527.13
本报告期基金总申购份额	268,457,557.65
减:本报告期基金总赎回份额	923,988,186.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	485,576,898.78

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华钻石品质企业股票型证券投资基金募集的文件
(二)关于申请募集新华钻石品质企业股票型证券投资基金之法律意见书
(三)《新华钻石品质企业股票型证券投资基金托管协议》
(四)《新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金合同》
(五)《新华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
(六)更新的《新华钻石品质企业股票型证券投资基金招募说明书》
(七)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
(八)基金托管人业务资格批件及营业执照

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理有限公司
二〇一五年七月二十日

新华中证环保产业指数分级证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华中证环保产业指数分级
场内简称	新华环保
基金主代码	164304
交易代码	164304
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月11日
报告期末基金份额总额	1,679,042,496.41份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,以实现对标的指数的有效跟踪,在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在中证环保产业指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	95%×中证环保产业指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金是指数型基金,具有较高预期收益、较高预期风险的特征。预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数获取,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 从本基金的基金份额来看,新华环保A份额为稳健收益类份额,具有低预期风险且预期收益相对较低的特征;新华环保B份额为积极收益类份额,具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

下属三级基金的基金简称	新华环保A	新华环保B	新华环保
下属三级基金的场内简称	NCF环保A	NCF环保B	新华环保
下属三级基金的交易代码	150190	150191	164304
报告期末下属三级基金的份额总额	672,862,074.00份	672,862,074.00份	333,318,348.41份
风险收益特征	低预期风险且预期收益相对较低。	高预期风险且预期收益相对较高的。	较高预期收益、较高预期风险。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	863,036,387.29
2.本期利润	595,244,355.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.2149
4.期末基金资产净值	1,689,650,597.28
5.期末基金份额净值	1.006

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.本基金于2014年9月11日基金合同生效。

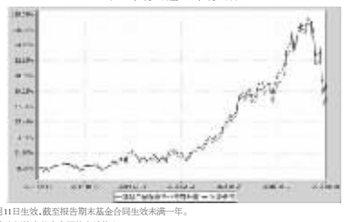
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	10.35%	3.19%	15.71%	2.88%	-5.36%	0.31%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

新华中证环保产业指数分级证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年9月11日至2015年6月30日)



注:1.本基金合同于2014年9月11日生效,截至报告期末基金合同生效未满一年。
2.报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李会忠	本基金基金经理、新华基金管理有限公司金融工程部副总监、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫回报债券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。	2014-09-15