新华灵活主题混合型证券投资基金

2015年度报告摘要

2015年12月31日

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十六日

§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。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25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业绩。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。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告财务材料已经审计。
本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华灵活主题混合
基金主代码	519009
交易代码	519009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9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	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	26,174,541.35份

2.2 基金产品说明

投资目标	以主题投资为核心,捕捉投资标的长期主题趋势,动态把握标的投资性的主题转换,并精选获益程度高的主题个股进行投资,在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续、稳定增长。
投资策略	本基金以战略性行业本性资产配置策略为指导,围绕市场的长期性和阶段性投资主题进行动态配置,并精选获益程度最高的主题个股群进行重点投资。
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	本基金为混合型基金,基金资产整体的预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

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		新华基金管理股份有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐轩	方赫
	联系电话	010-88423386	010-85936330
	电子邮箱	qiyan@xhx-fund.com.cn	fangxuehe@citic.bank.com
客户服务电话		4008198866	95558
传真		010-88423310	010-85230024

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.xcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地。

2.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现数据			
本期利润	-23,768,223.35	13,582,187.68	31,519,685.03
加权平均基金份额本期利润	-0.9602	0.4383	0.1969
本期基金份额净值增长率	33.48%	39.18%	15.42%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.2830	0.4744	0.1003
期末基金资产净值	40,049,132.35	63,808,356.21	50,024,215.83
期末基金份额净值	1.530	1.835	1.100

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减去期末公允价值变动损益(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
过去三个月	16.17%	1.83%	13.57%	1.34%	2.60%	0.51%
过去六个月	1.37%	2.93%	-12.31%	2.14%	13.68%	0.79%
过去一年	33.48%	2.70%	6.99%	1.99%	26.49%	0.71%
过去三年	114.43%	1.84%	43.01%	1.43%	71.42%	0.41%
自基金合同生效起至今	104.36%	1.66%	24.60%	1.32%	79.76%	0.34%

注:1.本期业绩比较基准采用每日按照比较基准收益率计算方式(80%×沪深300指数+20%×上证国债指数),复权比较基准为(80%×沪深300指数收益率+20%×上证国债指数收益率)。
2.本基金过往业绩比较基准采用每日按照收益率的计算方法。
3.2.2 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

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十六日

§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。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25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业绩。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。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告财务材料已经审计。
本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华灵活主题混合
基金主代码	519009
交易代码	519009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9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	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	26,174,541.35份

2.2 基金产品说明

投资目标	以主题投资为核心,捕捉投资标的长期主题趋势,动态把握标的投资性的主题转换,并精选获益程度高的主题个股进行投资,在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续、稳定增长。
投资策略	本基金以战略性行业本性资产配置策略为指导,围绕市场的长期性和阶段性投资主题进行动态配置,并精选获益程度最高的主题个股群进行重点投资。
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	本基金为混合型基金,基金资产整体的预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

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		新华基金管理股份有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐轩	方赫
	联系电话	010-88423386	010-85936330
	电子邮箱	qiyan@xhx-fund.com.cn	fangxuehe@citic.bank.com
客户服务电话		4008198866	95558
传真		010-88423310	010-85230024

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.xcfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地。

2.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

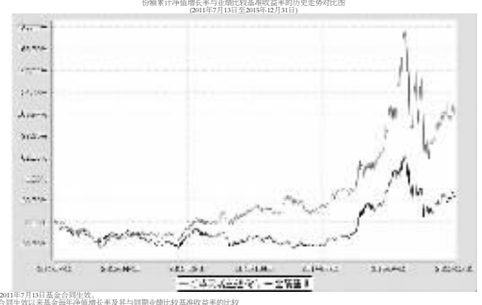
3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现数据			
本期利润	-23,768,223.35	13,582,187.68	31,519,685.03
加权平均基金份额本期利润	-0.9602	0.4383	0.1969
本期基金份额净值增长率	33.48%	39.18%	15.42%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.2830	0.4744	0.1003
期末基金资产净值	40,049,132.35	63,808,356.21	50,024,215.83
期末基金份额净值	1.530	1.835	1.100

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减去期末公允价值变动损益(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
过去三个月	16.17%	1.83%	13.57%	1.34%	2.60%	0.51%
过去六个月	1.37%	2.93%	-12.31%	2.14%	13.68%	0.79%
过去一年	33.48%	2.70%	6.99%	1.99%	26.49%	0.71%
过去三年	114.43%	1.84%	43.01%	1.43%	71.42%	0.41%
自基金合同生效起至今	104.36%	1.66%	24.60%	1.32%	79.76%	0.34%

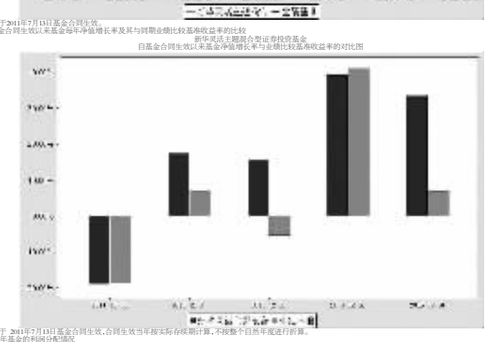
注:1.本期业绩比较基准采用每日按照收益率的计算方法。
3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华灵活主题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的历史走势对比图
(2011年7月13日至2015年12月31日)



注:本基金于2011年7月13日基金合同生效。
3.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华灵活主题混合型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金于2011年7月13日基金合同生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个日历年度进行折算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	4.830	810,607,441.84	1,549,535.43	812,156,977.27	
合计	4.830	810,607,441.84	1,549,535.43	812,156,977.27	

§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
新华基金管理股份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,总投资额为人民币5亿元,是全国第一批基金管理公司。
截至2015年12月31日,新华基金管理股份有限公司旗下管理开放式基金,新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优势精选股票证券投资基金、新华优质成长证券投资基金、新华钻石品质企业股票证券投资基金、新华行业周期轮换股票证券投资基金、新华中小市值优选股票证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选价值混合型证券投资基金、新华趋势策略混合型证券投资基金、新华趋势策略股票证券投资基金、新华策略精选股票证券投资基金、新华安享基金定期开放债券型证券投资基金、新华安享基金货币市场基金、新华信用增益债券型证券投资基金、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、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫安保本一年期混合型证券投资基金、新华中证保产业指数分级证券投资基金、新华中证保险主题指数分级证券投资基金、新华财富策略灵活配置混合型证券投资基金、新华一带一路主题灵活配置混合型证券投资基金、新华中证内地低碳指数证券投资基金、新华中证内地资源主题指数证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华灵活一年保本混合型证券投资基金和新华稳健回报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,新华基金管理股份有限公司金融工程和量化部总监,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,新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理,新华增益回报债券型证券投资基金基金经理,新华稳健回报债券型证券投资基金基金经理,新华行业轮换股票证券投资基金基金经理,新华灵活一年保本混合型证券投资基金基金经理,新华中证内地资源主题指数证券投资基金基金经理,新华中证内地低碳主题指数证券投资基金基金经理,新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理,新华钻石品质企业股票证券投资基金基金经理,新华策略精选股票证券投资基金基金经理,新华优质成长证券投资基金基金经理,新华中证保险主题指数证券投资基金基金经理,新华财富策略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,新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫安保本一年期混合型证券投资基金基金经理,新华信用增益债券型证券投资基金基金经理,新华安享基金定期开放债券型证券投资基金基金经理,新华安享基金货币市场基金基金经理,新华趋势策略混合型证券投资基金基金经理,新华灵活价值混合型证券投资基金基金经理,新华灵活趋势策略混合型证券投资基金基金经理,新华灵活一年保本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	2015-06-11	-	8	经济学硕士,证券从业经历。2007年9月加入新华基金管理股份有限公司,历任新华基金管理股份有限公司行业研究员、策略分析师、新华钻石品质企业股票证券投资基金基金经理助理、新华策略精选股票证券投资基金基金经理助理、现任新华基金管理股份有限公司金融工程和量化部总监,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,新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华证券投资基金基金经理,新华安享基金定期开放债券型证券投资基金基金经理,新华增益回报债券型证券投资基金基金经理,新华稳健回报债券型证券投资基金基金经理,新华行业轮换股票证券投资基金基金经理,新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理,新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理,新华中证内地资源主题指数证券投资基金基金经理,新华中证内地低碳主题指数证券投资基金基金经理,新华灵活一年保本混合型证券投资基金基金经理,新华财富策略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,新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫安保本一年期混合型证券投资基金基金经理,新华信用增益债券型证券投资基金基金经理,新华安享基金定期开放债券型证券投资基金基金经理,新华安享基金货币市场基金基金经理,新华趋势策略混合型证券投资基金基金经理,新华灵活价值混合型证券投资基金基金经理,新华灵活趋势策略混合型证券投资基金基金经理,新华灵活一年保本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		
孔雪梅	本基金基金经理。	2014-01-02	2015-06-15	7	管理学硕士,于2008年3月加入新华基金管理股份有限公司,负责行业研究,历任新华基金管理股份有限公司研究员职务,新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理助理,新华行业轮换股票证券投资基金基金经理助理,现任新华基金管理股份有限公司行业研究员职务,新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理,新华优势精选股票证券投资基金基金经理,新华钻石品质企业股票证券投资基金基金经理,新华增益回报债券型证券投资基金基金经理,新华稳健回报债券型证券投资基金基金经理,新华行业轮换股票证券投资基金基金经理,新华灵活一年保本混合型证券投资基金基金经理,新华财富策略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,新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫安保本一年期混合型证券投资基金基金经理,新华信用增益债券型证券投资基金基金经理,新华安享基金定期开放债券型证券投资基金基金经理,新华安享基金货币市场基金基金经理,新华趋势策略混合型证券投资基金基金经理,新华灵活价值混合型证券投资基金基金经理,新华灵活趋势策略混合型证券投资基金基金经理,新华灵活一年保本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		

注:1.此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业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,新华基金管理股份有限公司作为新华灵活主题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》、《新华灵活主题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,不断完善规章制度,加强内部控制和风险管理,确保基金资产、客户利益风险的最小化,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
报告期内,基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度》的规定。
基金管理人对属下所有投资组合同时在市场上进行的投资决策、交易指令发出、交易执行、交易结果分配等环节,均实施了公平对待的原则。
报告期内,公平交易制度的执行情况主要体现在:
1.投资决策方面,公司投资决策委员会定期召开投资决策委员会会议,对投资组合的投资方向、投资比例、投资品种、投资时机等重大投资决策事项进行讨论,并形成决议,投资决策委员会决议对公司旗下所有投资组合均具有指导性作用,公司