新华策略精选股票型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年七月十九日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华策略精选股票
基金主代码	001040
交易代码	001040
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月31日
报告期末基金份额总额	1,381,237,523.88份
投资目标	把握整体市场和行业中的机会,精选投资策略,寻找具有行业增长潜力和价值低估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净值的持续、稳定增长。
投资策略	1.资产配置策略 本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,并据此评估未来一段时间股票、债券市场相对收益率,主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置,以便基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上,优化投资组合。 2.股票投资策略 本基金采用自上而下与自下而上相结合的主动投资策略,深入分析并积极跟踪驱动股票市场、行业板块、公司股价形成上升趋势的根本性因素,通过前瞻性地把握市场中存在的趋势机会,人手选择具有长期可持续成长能力的股票。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为: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,基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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 (2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	-8,124,211.67
2.本期利润	17,831,748.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0127
4.期末基金资产净值	1,247,675,949.03
5.期末基金份额净值	0.903

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。

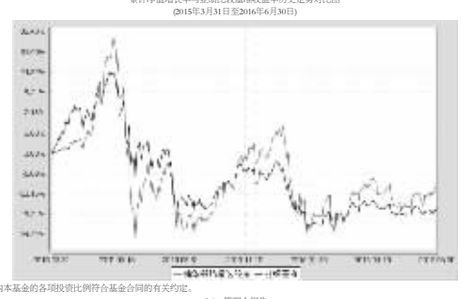
3.2 基金净值表现

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	1.46%	1.41%	-1.42%	0.81%	2.88%	0.60%

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

新华策略精选股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年3月31日至2016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		
崔建波	本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监,基金管理部总监、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理,新华趋势领航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,新华优选分红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发起式证券投资基金基金经理,新华战略新兴产业灵活配置混合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。	2015-03-31	-	21	经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津侨鑫营业部投资经理顾问部经理、海融资讯系统有限公司研究员、和讯信息科技有限公司证券研究部、理财服务部经理、北方国际信托股份有限公司投资部信托高级投资经理。现任新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监、基金管理部总监、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理、新华趋势领航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、新华策略精选股票型证券投资基金基金经理、新华优选分红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发起式证券投资基金基金经理、新华战略新兴产业灵活配置混合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。
栾江伟	本基金基金经理,新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华沪深两优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-07-16	-	7	硕士研究生,7年证券从业经验,2008年7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研究部行业分析师、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华策略精选股票型证券投资基金基金经理、新华沪深两优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华健康生活主题灵活配置混合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,新华基金管理股份有限公司作为新华策略精选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》、《新华策略精选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《新华基金管理股份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会议,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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2016年2季度市场维持窄幅震荡行情,板块和个股涨跌分化非常大,部分强势股块如OLED、锂电、稀土、电子、食品饮料、家电等板块涨幅巨大,而餐饮旅游、传媒等板块下跌,截止6月末板块轮动越来越快,强者恒强特征更加明显,赚钱难度明显加大,2季度上证综指下跌2.5%,创业板指上涨0.5%,新华策略精选基金上涨1.46%,涨幅好于主板和创业板,保持中性仓位,板块配置方面,重点配置医药、计算机、机械、化工、房地产、电子等板块。预计2016年3季度保持中性仓位,均衡配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年06月30日,本基金份额净值为0.903元,本报告期份额净值增长率为1.46%,同期比较基准的增长率为-1.42%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2016年3季度经济将窄势整理,5-6月经济数据再次转差,一二线城市房价环比继续上涨,通胀压力减少,美联储加息预期降低,英国退欧的中长期影响可能反复发作。预计2016年3季度国内货币政策继续维持中性,货币刺激的边际效应下降,降息可能性很小,降准还有空间。财政政策有望继续发力。

下半年稳增长的重要性提升,周期性板块的涨价值得重视,股票有反复炒作机会。3季度创业板调整压力仍然较大,反弹后小非减持压力增多,创业板估值仍然较高,外延扩张和内生增长减速导致业绩增速将逐季下滑。

2016年3季度股市仍然是个存量博弈市场,资金呈现集中优势快进快出优势,股市调整压力加大,7月初冲高后可能面临1-2月的整固,指数调整幅度不会大,上半年涨幅过大的板块调整压力更大,上半年涨幅较小或下跌的板块可能有一定机会。3季度本市场可能再次出现系统性赚钱机会,中长期看,代表未来发展方向的新兴行业有反复炒作机会,下半年可关注现代服务业(养老、医疗、医美、体育、教育等)和新材料(石墨烯、燃料电池等),等的成长机会。小市值壳资源仍然可以布局,耐心等待机会。3季度将关注深港通出台时间、SDR实施以及G20会议。

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的情形。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,103,049,983.50	87.68
	其中:股票	1,103,049,983.50	87.68
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	151,434,894.35	12.04
7	其他各项资产	3,520,146.07	0.28
8	合计	1,258,005,023.92	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	19,349,729.36	1.55
B	采矿业	38,250,267.07	3.07
C	制造业	588,005,968.39	47.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,199,286.74	3.70
E	建筑业	7,732,458.72	0.62
F	批发和零售业	77,381,720.87	6.20
G	交通运输、仓储和邮政业	22,911,534.00	1.84
H	住宿和餐饮业	7,848,954.84	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	101,342,295.19	8.12
J	金融业	57,796,052.31	4.63
K	房地产业	111,888,618.43	8.97
L	租赁和商务服务业	3,852,000.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	5,579,920.04	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	5,606,088.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,919,865.54	0.39
R	文化、体育和娱乐业	4,385,224.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	1,103,049,983.50	88.41

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	000797	中国武夷	1,675,491	25,031,835.54	2.01
2	000488	晨鸣纸业	2,568,727	20,395,692.38	1.63
3	600476	湘邮科技	680,777	19,191,103.63	1.54
4	000568	泸州老窖	618,280	18,362,916.00	1.47
5	600511	国药股份	609,696	16,717,864.32	1.34
6	600028	中国石化	3,500,000	16,520,000.00	1.32
7	600203	福日电子	1,159,696	16,003,804.80	1.28
8	600887	伊利股份	950,000	15,836,500.00	1.27
9	600266	北京城建	1,250,000	15,612,500.00	1.25
10	600835	上海机电	801,600	15,382,704.00	1.23

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

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

本基金合同尚无股指期货的投资政策。

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

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本报告期末本基金投资的前十名证券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、处罚的情形。

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	408,952.50
2	应收证券清算款	2,976,947.13
3	应收股利	-
4	应收利息	28,032.20
5	应收申购款	106,214.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,520,146.07

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	600511	国药股份	16,717,864.32	1.34	筹划重大资产重组,停牌
2	600203	福日电子	16,003,804.80	1.28	因重大事项未公告,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

本报告期期初基金份额总额	1,417,218,265.68
报告期基金总申购份额	28,117,122.76
减:报告期基金总赎回份额	64,097,864.56
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,381,237,523.88

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	12,134,708.74
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	12,134,708.74
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.88

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内未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华策略精选股票型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华策略精选股票型证券投资基金之法律意见书

(三)中国证监会关于核准新世纪基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

(四)《新华策略精选股票型证券投资基金基金合同》

(五)《新华策略精选股票型证券投资基金托管协议》

(六)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(七)更新的《新华策略精选股票型证券投资基金招募说明书》

(八)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(九)基金托管人业务资格批件及营业执照

(十)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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。

新华基金管理股份有限公司
二〇一六年七月十九日

新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年七月十九日

§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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华安享惠金定期债券
基金主代码	519160
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月13日
报告期末基金份额总额	226,844,659.95份
投资目标	本基金在严格控制投资风险和增强基金资产流动性的基础上,力争获取超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括:期限配置策略、利率预期策略、类属品种配置策略以及证券选择策略。采用定量与定性相结合的研究方法,深入分析市场利率发展方向、期限结构变化趋势,信用主体评级水平以及单个债券的投资价值。积极主动进行类属品种配置及个券选择,谋求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利息收益率+1.2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	新华安享惠金定期债券A类 新华安享惠金定期债券C类
下属分级基金的交易代码	519160 519161
报告期末下属分级基金的份额总额	199,443,758.68份 27,400,901.27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 (2016年4月1日-2016年6月30日)	
	新华安享惠金定期债券A类	新华安享惠金定期债券C类
1.本期已实现收益	2,395,909.54	298,368.24
2.本期利润	1,317,984.66	151,772.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0066	0.0055
4.期末基金资产净值	231,868,846.70	31,497,424.24
5.期末基金份额净值	1.163	1.150

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

1.新华安享惠金定期债券A类:

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	0.61%	0.07%	0.68%	0.00%	-0.07%	0.07%

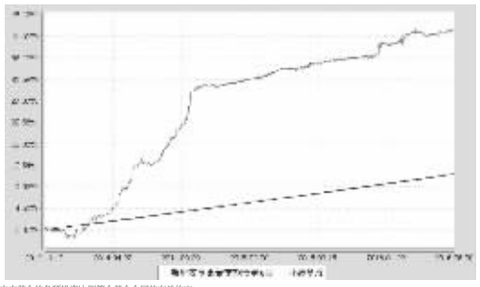
2.新华安享惠金定期债券C类:

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	0.52%	0.07%	0.68%	0.00%	-0.16%	0.07%

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

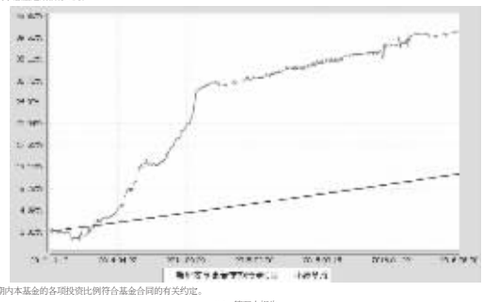
新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年11月13日至2016年6月30日)

1. 新华安享惠金定期债券A类:



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。

2. 新华安享惠金定期债券C类:



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		
于泽雨	本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司固定收益部总监,新华纯债添利债券型发起式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,新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理,新华信用增强债券型证券投资基金基金经理,新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理助理。	2013-11-13	-	8	经济学博士,8年证券从业经验,历任华安财产保险公司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理,于2012年10月加入新华基金管理股份有限公司。现任新华基金管理股份有限公司固定收益部总监,新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券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、新华信用增强债券型证券投资基金基金经理、新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理、新华信用增强债券型证券投资基金基金经理。
马亮	本基金基金经理,新华财富金30天理财债券型证券投资基金基金经理,新华德金宝货币市场基金基金经理,新华活期添利货币市场基金基金经理,新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理。	2016-06-01	-	8	金融学硕士,8年证券从业经验,历任第一创业证券有限责任公司固定收益部业务董事,第一创业摩根大通证券有限责任公司投资银行部副总经理,2012年11月加入新华基金管理股份有限公司,历任固定收益部债券研究员、新华查诺宝货币市场基金基金经理助理。现任新华财富金30天理财债券型证券投资基金基金经理、新华查诺宝货币市场基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理、新华丰盈回报债券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,新华基金管理股份有限公司作为新华安享惠金定期开放债券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》、《新华安享惠金定期开放债券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《新华基金管理股份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会议,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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2季度,长端收益率曲线经历了先波动上行后快速下行的过程。前期,主要基于信贷数据向好、地产销售投资回暖、大宗商品食品涨价预期,同时市场担心资金面的季末效应;之后,上述预期被一一打破,此外英国脱欧导致市场风险偏好得显回落,同时也引发了美联储加息再度延后的预期,前期积累的配置需求加速收益率曲线变平,股票市场也经历了先震荡调整后被动反弹的过程。该基金进于6月份进入第二个保本周期,主要着手相关资产的配置操作,以搭建初步的安全垫,考虑到该基金的保本性质,债券底仓以中短久期高等级为主,股票底仓也顺应相对保守操作,优先选择低估值品种,在此基础上择机增加相对确定的弹性品种。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日,本基金份额净值为1.009元,本报告期份额净值增长率为-0.05%,同期比较基准的增长率为0.93%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,前半段由于经济下行压力加大,CPI重新下行,叠加英国脱欧负面作用渐显导致避险需求增加,配置需求积累等因素,长端收益率下行推动曲线变平是大概率事件。随后,政府稳增长压力加大,员不改变趋势,但是一系列措施会使经济下行的压力有所缓解,此外,CPI在三季度经历年度低点后有所抬升,以及南方水灾对物价的影响或抑制收益率继续下行。总之,收益率在三季度将呈现震荡走势,同时,去杠杆、信用风险、风险偏好变化等会加大其波动。考虑到该基金的性质,我们将在防范信用风险的基础上,维持中短久期配置,并密切关注各种因素对中长端收益率的影响,寻找长久期的波段操作机会,股票配置上,本基金将以低估值品种为主,并关注市场带来的其他机会。

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形。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	279,440,382.70	96.69
	其中:债券	279,440,382.70	96.69
	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	2,187,086.02	0.76
7	其他各项资产	7,385,005.24	2.56
8	合计	289,012,473.96	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	150,643,405.00	57.20
5	企业短期融资券	90,359,000.00	34.31
6	中期票据	36,950,500.00	14.03
7	可转债(可交换债)	1,487,477.70	0.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	279,440,382.70	106.10

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122843	11绿化债	250,000	25,327,500.00	9.62
2	1280437	12立业债	200,000	20,542,000.00	7.80
3	041560060	15兴发CP002	200,000	20,168,000.00	7.66
4	011599972	15鲁焦化SCP002	200,000	20,118,000.00	7.64
5	011599879	15昆钢SCP005	200,000	20,054,000.00	7.61

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

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

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

本基金合同尚无股指期货的投资政策。

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政策。

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本报告期内,本基金投资的前十名债券的发行主体没有出现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、处罚的情形。

5.11.2本报告期内,本基金无股票投资。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	96,876.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,288,128.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,385,005.24

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金无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

报告期末,本基金无股票投资。

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

项目	新华安享惠金定期债券A类	新华安享惠金定期债券C类
本报告期期初基金份额总额	199,443,758.68	27,400,901.27
报告期基金总申购份额	-	-
减:报告期基金总赎回份额	-	-
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	199,443,758.68	27,400,901.27

§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末未持有本基金

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影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未有影响投资者决策的其他重要信息。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

(一)中国证监会批准新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金托管协议》

(四)《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金合同》

(五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(六)更新的《新华安享惠金定期开放债券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

(九)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

9.2存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3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。

新华基金管理股份有限公司
二〇一六年七月十九日

新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

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:二〇一六年七月十九日

§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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报