# 新华灵活主题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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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 | 新华灵活主题混合 |
| 基金主代码 | 519099 |
| 交易代码 | 519099 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年7月13日 |
| 报告期末基金份额总额 | 93,616,111.32份 |
| 投资目标 | 以主题投资为核心,前瞻性挖掘市场的长期主题趋势,动态把握市场阶段性的主题转换,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 | 本基金以战略性与战术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风险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。 |
| 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 |

§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 | -540,602.45 |
| 2.本期利润 | 3,644,949.21 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0442 |
| 4.期末基金资产净值 | 121,546,889.86 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.298 |

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

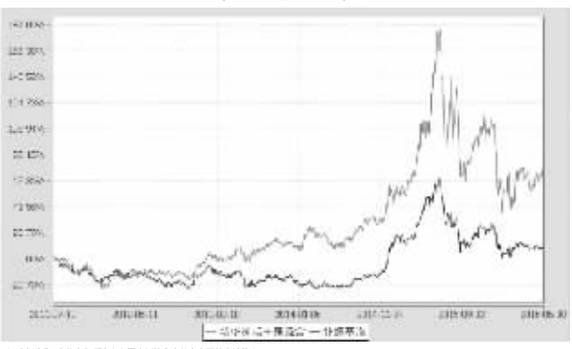
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.88% | 1.62% | -1.42% | 0.81% | 3.30% | 0.81% |

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

新华灵活主题混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年7月13日至2016年6月30日)



注:本报告期,本基金各项资产配置比例符合本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,新华基金管理股份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,新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 | 2015-06-11 | - | 9 | 经济学硕士,9年证券从业经验。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,新华钻石品质企业混合型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,新华中证环保产业指数分级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,新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫动力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,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年二季度,市场低位横盘整理,新能源汽车、智能驾驶相关电子元器件、有色金属、食品饮料走势较好。本基金在维持较高仓位的基础上适度仓位调整、波段操作,同时优选个股,取得了较好的投资收益。

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1.298元,本报告期份额净值增长率为1.88%,同期比较基准的增长率为1.62%。

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,我们认为市场将以震荡格局为主,难有趋势性行情。我们将优选那些质地好、有业绩、估值低、符合转型和改革大方向的股票进行配置。

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) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 109,826,421.35 | 87.54 |
| | 其中:股票 | 109,826,421.35 | 87.54 |
| 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 | 14,101,271.36 | 11.24 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,525,011.38 | 1.22 |
| 8 | 合计 | 125,452,704.09 | 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 | 153,594.00 | 0.13 |
| B | 采矿业 | 2,334,676.00 | 1.92 |
| C | 制造业 | 51,725,461.34 | 42.56 |
| D | 电力,热力,燃气及水生产和供应业 | 659,380.23 | 0.54 |
| E | 建筑业 | 545,994.00 | 0.45 |
| F | 批发和零售业 | 3,487,410.82 | 2.87 |
| G | 交通运输,仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输,软件和信息技术服务业 | 33,324,837.88 | 27.42 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 5,784,457.20 | 4.76 |
| L | 租赁和商务服务业 | 825,660.00 | 0.68 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 469,392.00 | 0.39 |
| N | 水利,环境和公共设施管理业 | 690,113.00 | 0.57 |
| O | 居民服务,修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 431,054.00 | 0.35 |
| R | 文化,体育和娱乐业 | 6,780,340.40 | 5.58 |
| S | 综合 | 2,614,050.48 | 2.15 |
| | 合计 | 109,826,421.35 | 90.36 |

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 | 300339 | 润和软件 | 54,500 | 1,953,280.00 | 1.61 |
| 2 | 300377 | 赢时胜 | 33,100 | 1,638,119.00 | 1.35 |
| 3 | 300253 | 卫宁健康 | 62,209 | 1,536,562.30 | 1.26 |
| 4 | 000983 | 西山煤电 | 175,700 | 1,431,955.00 | 1.18 |
| 5 | 300352 | 北信源 | 75,660 | 1,412,572.20 | 1.16 |
| 6 | 300287 | 飞利信 | 98,200 | 1,315,880.00 | 1.08 |
| 7 | 002292 | 奥飞娱乐 | 41,729 | 1,249,783.55 | 1.03 |
| 8 | 300348 | 长亮科技 | 33,600 | 1,241,856.00 | 1.02 |
| 9 | 300075 | 数字政通 | 46,900 | 1,202,985.00 | 0.99 |
| 10 | 002609 | 捷顺科技 | 64,700 | 1,138,073.00 | 0.94 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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

本基金本报告期末无权证投资。

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

本基金在报告期末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

本基金在报告期末尚无国债期货的投资政策。

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,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

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 78,876.56 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,780.98 |
| 5 | 应收申购款 | 1,443,353.84 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,525,011.38 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有债券投资。

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的情况。

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 | 57,481,291.41 |
| 报告期基金总申购份额 | 46,302,554.03 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 10,167,734.10 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 93,616,111.32 |

§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 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灵活主题混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华灵活主题混合型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华灵活主题混合型证券投资基金托管协议》

(四)《新华灵活主题混合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《新华灵活主题混合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

# 新华万银多元策略灵活配置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 | 新华万银多元策略灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 000972 |
| 交易代码 | 000972 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年4月10日 |
| 报告期末基金份额总额 | 119,694,155.12份 |
| 投资目标 | 综合运用多种投资策略,在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,力争为投资人提供长期稳定的绝对回报。 |
| 投资策略 | 投资策略的选择,本基金将兼顾下行风险控制和收益获取,在资产配置策略方面,主要采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在股票投资策略方面,把握主题投资、趋势跟随及绝对收益三个核心。主题投资策略以选择主题类板块为主要投资标的进行投资;趋势跟随策略以期在某行业或个股出现趋势性机会时,积极跟随其市场表现;绝对收益策略以类套利策略为目标,以期获取稳定的绝对回报。在债券投资策略方面,本基金将综合运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略、中小企业私募债券投资策略及可转换债券投资策略,在获取稳定收益的同时,降低基金资产净值整体的波动性。 |
| 业绩比较基准 | 60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 新华基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 |

§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 | -2,073,546.21 |
| 2.本期利润 | 3,153,010.13 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0252 |
| 4.期末基金资产净值 | 113,408,900.17 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.947 |

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),记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 | 2.82% | 1.15% | -0.86% | 0.61% | 3.68% | 0.54% |

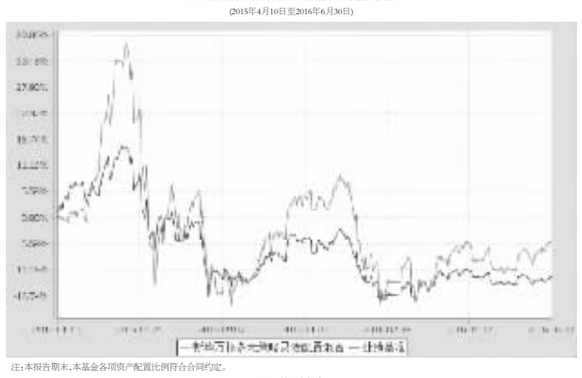
注:本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金

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4月10日至2016年6月30日)



注:本报告期末,本基金各项资产配置比例符合合同约定。

§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 | | |
| 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,新华策略灵活配置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。 | 2016-06-17 | - | 21 | 经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员,中银万国天津珠江花园证券投资咨询部经理兼投资总监,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,新华策略灵活配置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。 |
| 资兴振 | 本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司基金管理部副总监,新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理,新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。 | 2015-04-10 | 2016-06-28 | 9 | 经济学硕士,9年证券从业经验。历任北京城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股份有限公司,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,历任新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理,新华钻石品质企业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。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。 |

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万银多元策略灵活配置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》、《新华万银多元策略灵活配置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,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

市场在经历了一季度的巨幅波动之后,二季度整体是窄幅震荡的格局,期间上证综指下跌2.47%,创业板指下跌0.47%。本基金维持较中性仓位水平,通过加强精选个股,波段操作,期间净值上涨2.82%,跑赢上证综指5.29个百分点,跑赢创业板指3.29个百分点,优于大盘表现。配置方面,行业配置较为均衡,精选各个行业中基本面优质的上市公司,进行长期投资。

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0.947元,本报告期份额净值增长率为2.82%,同期比较基准的增长率为-0.86%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看,对于2016年我们保持谨慎乐观。预计2016年经济仍将弱而不破,上有压力,下有底线。虽然3月整体宏观数据略超市场预期,但后续月份数据受房地产和制造业投资拖累,压力再现。货币政策中性偏宽松,降准未来仍有空间。短期关联储加息担忧缓解,未来2个月市场处于空窗期,有利于投资者热情恢复。

近期南方多地遭受洪水袭击,农业、工程建设、电力等行业因而受到影响,短期我们将会适度调整相关行业的配置,总体仍将保持中性仓位,均衡配置,精选个股。

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 | 77,649,433.50 | 68.12 |
| | 其中:股票 | 77,649,433.50 | 68.12 |
| 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 | 36,197,244.84 | 31.76 |
| 7 | 其他各项资产 | 138,039.34 | 0.12 |
| 8 | 合计 | 113,984,717.68 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 988,023.00 | 0.87 |
| C | 制造业 | 48,014,041.08 | 42.34 |
| D | 电力,热力,燃气及水生产和供应业 | 927,630.00 | 0.82 |
| E | 建筑业 | 1,117,790.82 | 0.99 |
| F | 批发和零售业 | 648,599.76 | 0.57 |
| G | 交通运输,仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输,软件和信息技术服务业 | 9,061,969.55 | 7.99 |
| J | 金融业 | 6,176,731.96 | 5.45 |
| K | 房地产业 | 4,592,738.72 | 4.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,677,578.54 | 2.36 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利,环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务,修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 280,600.00 | 0.25 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化,体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 3,163,730.07 | 2.79 |
| | 合计 | 77,649,433.50 | 68.47 |

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 | 000802 | 北京文化 | 80,700 | 1,898,064.00 | 1.67 |
| 2 | 601689 | 拓普集团 | 55,700 | 1,835,315.00 | 1.62 |
| 3 | 601688 | 华泰证券 | 97,000 | 1,835,240.00 | 1.62 |
| 4 | 001979 | 招商蛇口 | 127,923 | 1,822,902.75 | 1.61 |
| 5 | 002400 | 省广股份 | 105,170 | 1,486,052.10 | 1.31 |
| 6 | 000910 | 大亚科技 | 94,051 | 1,453,087.95 | 1.28 |
| 7 | 002214 | 大立科技 | 117,170 | 1,444,706.10 | 1.27 |
| 8 | 002048 | 宁波华翔 | 62,400 | 1,427,088.00 | 1.26 |
| 9 | 600735 | 新华锦 | 101,174 | 1,419,471.22 | 1.25 |
| 10 | 603338 | 浙江鼎力 | 30,700 | 1,415,270.00 | 1.25 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

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

本基金本报告期末无债券投资。

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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

本基金本报告期末无贵金属投资。

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

本基金本报告期末无权证投资。

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

本基金在报告期末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

本基金在报告期末尚无国债期货的投资政策。

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,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

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 129,316.53 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,811.48 |
| 5 | 应收申购款 | 1,911.33 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 138,039.34 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无债券投资。

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 | 000802 | 北京文化 | 1,898,064.00 | 1.67 | 重大事项停牌 |

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 | 129,750,044.42 |
| 报告期基金总申购份额 | 351,032.76 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 10,406,922.06 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 119,694,155.12 |

§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持有本基金。

§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万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《新华万银多元策略灵活配置混合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《新华万银多元策略灵活配置混合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

# 新华趋势领航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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月15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 | 新华趋势领航混合 |
| 基金主代码 | 519158 |
| 交易代码 | 519158 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年9月11日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,040,294,394.34份 |
| 投资目标 | 把握整体市场和行业中的趋势机会,精选具有盈利增长趋势以及股票价格趋势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 | 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、债券市场、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,完成本基金的大类资产配置、行业配置、债券类属品种配置以及投资组合的最终构建。 |
| 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,属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 新华基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

§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 | 13,972,739.72 |
| 2.本期利润 | 68,240,942.72 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0696 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,209,958,957.91 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.124 |

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),记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