新华壹诺宝货币市场基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	新华壹诺宝货币
基金主代码	000434
交易代码	000434
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月3日
报告期末基金份额总额	7,212,051,302.53份
投资目标	在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上,追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金采取以长期利率趋势分析为基础,结合短中期经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券类属配置和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资组合管理。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券基金,也低于混合型基金与股票型基金。
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(2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	46,690,374.23
2.本期利润	46,690,374.23
3.期末基金资产净值	7,212,051,302.53

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5466%	0.0022%	0.3362%	0.0000%	0.2104%	0.0022%

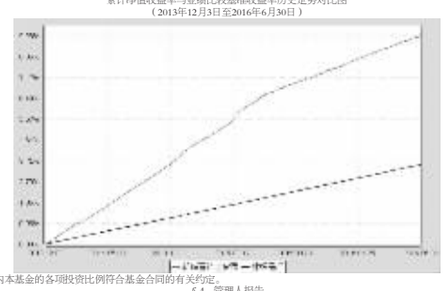
注:1.本基金利润分配是按日结转份额。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华壹诺宝货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年12月3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		
马英	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、新华活期添利货币市场基金基金经理、新华壹盈回报债券型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。	2015-07-10	-	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、新华壹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、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华壹盈回报债券型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。

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壹诺宝货币市场基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华壹诺宝货币市场基金基金合同》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,同时包括授权、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

回顾2016年上半年,经济增速换挡扩期稳增长和调结构政策交替侧重,收益率维持区间震荡状态。一方面,基建投资托底经济,宽财政发力,去库存影响推行,经济短期呈现弱复苏格局,债市收益率下有底部保障。另一方面,宏观基本面中长期仍然缺乏新动能,经济下行风险依然存在,收益率上有顶部约束。

年初债市收益曲线陡峭化下移后,二季度短端利率上行导致曲线更为平坦。由于信用风险和局部流动性的冲击,1年期国债和国开债上行约30个基点至2.4%和2.6%。长端收益率呈倒V型走势,经济短期企稳、通胀上升推动长端收益率上行后,6月基本面重回弱势,经济增长和金融数据低于预期,资金面维持稳定,海外动荡导致避险情绪上升,多重利好因素带动10年期国债和国开债回调至2.84%和3.19%。

本基金二季度配置主要为短融、存款和回购,基金份额有所减少,收益率相对比较平稳。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内基金份额净值收益率为0.5466%,同期业绩比较基准收益率为0.3362%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济"L"型格局下基本面预期变动不大,上半年总体信贷扩张较快,预计短期经济趋稳能持续。政策层面会采取宽财政、稳货币、紧信用的组合;财政、基建投资会继续托底经济;美国加息低于预期,但人民币中长期贬值担忧没有消除,货币政策进一步宽松临近;汇率制约;信用层面,去杠杆监管加强,信用债发行规模显著下降,下半年信贷投放压减少,需警惕企业再融资收缩和相应流动性风险冲击。

展望三季度,目前利率品政益曲线非常平坦,期限利差已显著低于年初水平,除非基本面继续恶化倒逼货币政策放松并带动短端利率下降,否则长端无风险利率较难实质前低,考虑到供给仍会维持高位,并且汇率约束仍在,通胀预期跟年初改益低点比已抬升,长端利率倾获利空间有限。信用债仍然会延续高低等级分化趋势,风险偏好没有回升,高等级信用债基本随利率债变动,中低等级仍然面临调整压力。

结合债券市场表现与流动性要求,本基金将采取较为灵活的策略应对市场变化,重点把握资金面波动时点,投向短融、存单和回购等,确保组合流动性,提高基金持有人的投资回报率。

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	固定收益投资	6,044,489,913.88	81.88
	其中:债券	6,044,489,913.88	81.88
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,285,121,357.41	17.41
4	其他各项资产	52,598,415.63	0.71
5	合计	7,382,209,686.92	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.46	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	164,999,797.50	2.29
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	75
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	22.21	2.29
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	31.61	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	27.78	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	14.90	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	5.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		101.63	2.29

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	摊余成本(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	849,716,676.46	11.78
	其中:政策性金融债	849,716,676.46	11.78
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,560,231,488.30	63.23
6	中期票据	-	-
7	同业存单	634,541,749.12	8.80
8	其他	-	-
9	合计	6,044,489,913.88	83.81
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150419	15农发19	3,000,000.00	300,123,106.67	4.16
2	160401	16农发01	3,000,000.00	299,526,794.27	4.15
3	011599971	15超交控SCP005	2,000,000.00	200,156,956.04	2.78
4	071602003	16国泰君安CP003	2,000,000.00	199,966,515.01	2.77
5	071603003	16中信CP003	1,500,000.00	149,984,313.58	2.08
6	011537011	15中建材SCP011	1,200,000.00	120,042,024.89	1.66
7	071603004	16中信CP004	1,200,000.00	119,983,367.23	1.66
8	011599975	15首旅SCP006	1,000,000.00	100,142,647.34	1.39
9	071630002	16财通证券CP002	1,000,000.00	99,998,607.32	1.39
10	071626001	16兴业证券CP001	1,000,000.00	99,997,108.61	1.39

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1060%
报告期内偏离度的最低值	0.0389%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0804%

5.7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

本报告期内,本基金未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

(1)基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际协议利率逐日计提利息;

(2)基金持有的回购协议(封闭式回购)以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;

(3)基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(4)基金持有的买断式回购以协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时,若双方都能履约,则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产,实际持有的相关资产按其性质进行估值;

(5)基金持有的资产支持证券视同债券,购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

5.8.2本报告期内本基金未持有剩余期限超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 2015年11月26日,16中信CP001的发行主体中信证券收到中国证监会调查通知书,其中提及,因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,证监会决定对公司进行立案侦查。该事项对于该债券的偿付本息构成实质性影响。

2016年1月29日,中小企业股份转让系统有限责任公司就2015年12月31日国泰君安在新三板做市业务中的异常报价行为给予公开谴责并对公司相关人员进行公开谴责和通报批评。

2016年2月26日公司收到上海监管局监管、公司场外市场部做市业务部门的绩效考核体系、内部管理与控制等方面存在重大缺陷,违反了《中国证监会关于进一步推进全国中小企业股份转让系统发展的若干意见》。

2016年6月16日,国泰君安期货有限公司收到证监会《调查通知书》因未能有效履行资产管理人职责,根据规定,对公司进行立案侦查。

2016年2月18日,兴业证券收到证监会警示函,经查,2015年7月7日融资融券强制平仓操作出现差错,导致客户信用账户股票的实际强制平仓数量远超过应当平仓数量,7月8日,公司未经客户同意直接在客户信用账户进行买回操作。

2016年7月9日,兴业证券披露《兴业证券股份有限公司关于收到行政处罚及市场禁入事先告知书》,公司在推荐欧泰电器在创业板IPO过程中未遵守行业规则和规范,提送文件存在虚假记载,未发现《招股意向书》《招股说明书》中涉及欧泰电器应收账款、流动资产、和经营活动产生现金流量净额等项目的财务数据存在虚假记载,证监会决定对公司给予警告,没收保荐收入1200万元,并处以2400万元罚款,没收承销费非法所得2078万元并处60万元罚款,对兰翔、伍文祥先生分别采取10年证券市场禁入措施。

除以上提到的证券外,本基金投资的其余前十名发行主体本期未发生被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内公开谴责、处罚的情形。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	52,537,803.03
4	应收申购款	60,612.60
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	52,598,415.63

5.8.5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	8,692,059,944.33
报告期基金总申购份额	3,067,814,464.66
报告期基金总赎回份额	4,547,823,106.46
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	7,212,051,302.53

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
-	申购	2016-04-12	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00%
合计			100,000,000.00	100,000,000.00	

§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壹诺宝货币市场基金募集的文件

(二)关于申请募集新华壹诺宝货币市场基金之法律意见书

(三)《新华壹诺宝货币市场基金托管协议》

(四)《新华壹诺宝货币市场基金基金合同》

(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《新华壹诺宝货币市场基金招募说明书》

(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

新华优选成长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	新华优选成长混合
基金主代码	519089
交易代码	519089
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2008年7月25日
报告期末基金份额总额	295,116,105.37份
投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,优选具有成长性兼具品质保障的上市公司为主要投资对象,力争持续地超越业绩比较基准,为投资者实现超额收益。
投资策略	本基金是混合型基金,选择具有成长性兼具品质保障的股票,因此主要采取自下而上的主动投资管理策略。当然仅应用自下而上的策略可能导致某行业股票集中度过高,行业配置不够分散,造成组合非系统风险高,再考虑到国内系统风险高,因此有必要辅助以适当的资产配置和行业配置策略进行调整。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
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。
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	639,684.26
2.本期利润	8,710,432.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0293
4.期末基金资产净值	440,891,274.96
5.期末基金份额净值	1.4940

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

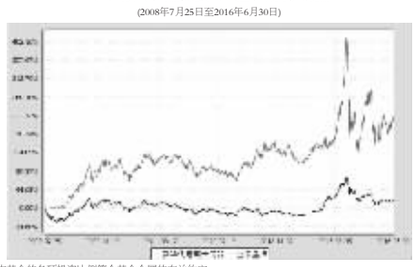
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.95%	2.00%	-1.42%	0.81%	3.37%	1.19%

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

新华优选成长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

(2008年7月25日至2016年6月30日)



注:本报告期末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		
付伟	本基金基金经理、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。	2015-08-25	-	6	西安交通大学工学硕士,北京大学工商管理硕士,6年证券从业经验。历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理,新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与TMT组组长、生后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。现任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、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、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。

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优选成长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》、《新华优选成长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,同时包括授权、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%。本基金维持较高仓位水平,通过加强精选个股,波段操作,期间净值上涨1.95%,跑赢上证综指4.42个百分点,跑赢创业板指2.42个百分点,优于大盘表现。配置方面,根据基金合同约定,主要投资于具有高成长性的新兴产业领域的个股,包括互联网、信息安全、电子、新能源汽车、军工、以及新兴消费等板块。未来将根据对市场的提前预判及时调整仓位配置,根据市场热点、成长性以及估值,精选主题和个股。

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1.4940元,本报告期份额净值增长率为1.95%,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

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,总体仍以精选高成长性行业和个股为主。

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	410,056,915.94	91.11
	其中:股票	410,056,915.94	91.11
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	29,818,523.05	6.63
7	其他各项资产	10,172,819.02	2.26
8	合计	450,048,258.01	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	-	-
C	制造业	216,901,234.49	49.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,940,000.00	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	5,066,000.00	1.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,615,292.40	21.01
J	金融业	9,776,000.00	2.22
K	房地产业	31,002,789.05	7.03
L	租赁和商务服务业	2,436,000.00	0.55
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	35,506,000.00	8.05
S	综合	7,813,600.00	1.77
	合计	410,056,915.94	93.01

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	600570	恒生电子	240,000	16,024,800.00	3.63
2	300114	中航电测	500,000	14,900,000.00	3.38
3	002373	千方科技	660,000	11,299,200.00	2.56
4	600458	时代新材	700,000	10,906,000.00	2.47
5	002273	水晶光电	360,000	10,076,400.00	2.29
6	600730	中国高科	700,000	9,891,000.00	2.24
7	002405	四维图新	400,000	9,840,000.00	2.23
8	601198	东兴证券	400,000	9,776,000.00	2.22
9	000802	北京文化	400,000	9,408,000.00	2.13
10	000615	京汉股份	500,043	9,175,789.05	2.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金无债券投资。

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

本报告期末本基金无债券投资。

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

本报告期末本基金无资产支持证券。

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

本报告期末本基金无贵金属投资。

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

本报告期末本基金无权证投资。

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

本基金合同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

本基金合同尚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

本基金合同尚无国债期货投资政策。

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	461,883.82
2	应收证券清算款	9,245,809.75
3	应收股利	-
4	应收利息	5,834.72
5	应收申购款	459,290.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,172,819.02

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	9,408,000.00	2.13	筹划重大事项
2	002373	千方科技	11,299,200.00	2.56	筹划重大事项

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	292,555,159.57
报告期基金总申购份额	27,230,996.78
减:报告期基金总赎回份额	24,670,050.98
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	295,116,105.37

§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

本报告期本基金管理人未投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人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)中国证监会批准新世纪优选成长混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新世纪优选成长混合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)《新华优选成长混合型证券投资基金基金合同》

(五)《新华优选成长混合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《新华优选成长混合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

新华优选分红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	新华优选分红混合	
基金主代码	519087	
交易代码	519087(前端)	519088(后端)
基金运作方式	契约型开放式	