新华中小市值优选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	新华中小市值优选混合
基金主代码	519097
交易代码	519097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月28日
报告期末基金份额总额	231,530,820.75份
投资目标	在有效控制风险的前提下，精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资，力求实现基金净值增长率持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金以合理价格成长选股策略（GARP）为核心，精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证700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	1,060,175.89
2.本期利润	14,650,410.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.6587
4.期末基金资产净值	360,262,427.78
5.期末基金份额净值	1.556

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	4.01%	1.32%	-0.99%	1.21%	5.00%	0.11%

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

新华中小市值优选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1月28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		
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，新华优选成长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。	2016-06-17	-	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行业研究员、制造业与TMT组组长，先后负责新能源、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。
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，新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。	2014-01-02	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基金管理部副总监。

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中小市值优选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》、《新华中小市值优选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。

境内交易，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4.01%，跑赢上证综指6.48个百分点，跑赢创业板指4.48个百分点，优于大盘表现。配置方面，行业配置较为均衡，精选各个行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资，追求获取长期超额收益。

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1.556元，本报告期份额净值增长率为4.01%，同期比较基准的增长率为-0.99%。

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。短期既储加息担忧缓解，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	260,142,968.28	71.33
	其中：股票	260,142,968.28	71.33
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	79,414,465.73	21.78
7	其他各项资产	25,125,621.66	6.89
8	合计	364,683,055.67	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	151,465,188.56	42.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,062,483.04	0.29
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,372,815.51	1.77
G	交通运输、仓储和邮政业	4,470,000.00	1.24
H	住宿和餐饮业	408,292.20	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,386,647.83	12.32
J	金融业	15,618,365.00	4.34
K	房地产业	16,722,754.42	4.64
L	租赁和商务服务业	4,058,822.60	1.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,087,271.96	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,640,083.50	1.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,850,243.66	3.01
S	综合	-	-
	合计	260,142,968.28	72.21

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	601689	拓普集团	200,000	6,590,000.00	1.83
2	600458	时代新材	400,000	6,232,000.00	1.73
3	300114	中航电测	200,000	5,960,000.00	1.65
4	000965	天保基建	1,000,000	5,920,000.00	1.64
5	600118	中国卫星	150,000	5,040,000.00	1.40
6	000988	华工科技	250,069	5,013,883.45	1.39
7	600887	伊利股份	300,000	5,001,000.00	1.39
8	002329	皇氏集团	330,000	4,946,700.00	1.37
9	002273	水晶光电	170,000	4,758,300.00	1.32
10	300133	华策影视	300,038	4,671,591.66	1.30

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

本基金合同中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

本基金合同中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 2016年5月25日，水晶光电（002273）控股股东星星集团有限公司收到中国证监会浙江证监局对公司下发的《关于对星星集团有限公司采取出具警示函措施的决定》，公司于2016年3月2日通过集中竞价的方式减持浙江水晶光电总股本的0.15%，但于2016年3月2日才将减持计划告知水晶光电，计划自3月2日起减持不超过2000万股无限售条件流通股，上述行为违反了《上市公司大股东、董监高减持股份的若干规定》，收到警示。此事项并不影响本基金的投资决策。

本基金投资其他前十名股票不存在被监管部门立案调查或编制目前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	285,668.55
2	应收证券清算款	24,453,539.43
3	应收股利	-
4	应收利息	16,878.94
5	应收申购款	369,534.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,125,621.66

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

报告期末，本基金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	255,628,928.95
报告期基金总申购份额	10,965,272.66
减：报告期基金总赎回份额	35,063,380.86
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	231,530,820.75

§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

本基金管理人于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中小市值优选混合型证券投资基金募集的文件

（二）关于申请募集新华中小市值优选混合型证券投资基金之法律意见书

（三）《新华中小市值优选混合型证券投资基金托管协议》

（四）《新华中小市值优选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《新华中小市值优选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

新华钻石品质企业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	新华钻石品质企业混合
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	258,123,219.59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80%。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	-1,157,458.15
2.本期利润	18,296,519.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.0704
4.期末基金资产净值	492,732,089.98
5.期末基金份额净值	1.909

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	3.86%	1.28%	-1.42%	0.81%	5.28%	0.47%

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

新华钻石品质企业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

（2010年2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		
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。	2016-06-17	-	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行业研究员、制造业与TMT组组长，先后负责新能源、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。
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，新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。	2015-06-08	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基金管理部副总监。

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钻石品质企业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》、《新华钻石品质企业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。

境内交易，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3.86%，跑赢上证综指6.33个百分点，跑赢创业板指4.33个百分点，优于大盘表现。配置方面，行业配置较为均衡，精选各个行业中具有钻石品质的优质上市公司，进行长期投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，本基金份额净值为1.909元，本报告期份额净值增长率为3.86%，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。短期既储加息担忧缓解，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	390,298,792.73	77.02
	其中：股票	390,298,792.73	77.02
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	115,673,344.67	22.83
7	其他各项资产	784,766.18	0.15
8	合计	506,756,903.58	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	222,836,169.79	45.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,421,494.40	0.69
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,053,060.19	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	2,977,794.80	0.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,519,628.95	10.66
J	金融业	34,949,277.01	7.09
K	房地产业	15,415,088.25	3.13
L	租赁和商务服务业	6,209,441.47	1.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,110,607.05	1.24
O	居民服务、修理和其他服务业	4,285,687.98	0.87
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	27,520,542.84	5.59
S	综合	-	-
	合计	390,298,792.73	79.21

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	601689	拓普集团	280,000	9,226,000.00	1.87
2	002405	四维图新	360,000	8,856,000.00	1.80
3	600887	伊利股份	500,000	8,335,000.00	1.69
4	300364	中文在线	160,085	8,324,420.00	1.69
5	600584	长电科技	400,072	8,117,460.88	1.65
6	300168	万达信息	300,000	7,797,000.00	1.58
7	002329	皇氏集团	500,034	7,495,509.66	1.52
8	002594	比亚迪	120,059	7,324,799.59	1.49
9	002690	美亚光电	300,047	6,913,082.88	1.40
10	000988	华工科技	330,014	6,616,780.70	1.34

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

本基金本报告期末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

5.11.12015年10月16日，中文在线（300364）高级管理人员宋洁，违反《上市公司董事、监事、和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》等相关规定违规通过竞价交易方式卖出公司股票2000股成交均价125.8元，行为在本人不知悉情况下由其亲属操作，受到监管部门的警告和公司相关处罚。此事项并不影响本基金的投资决策。

本基金其他投资前十名股票不存在被监管部门立案调查或编制目前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	291,119.69
2	应收证券清算款	346,985.96
3	应收股利	-
4	应收利息	24,873.08
5	应收申购款	121,787.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	784,766.18

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

报告期末，本基金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	261,776,509.55
报告期基金总申购份额	3,814,336.45
减：报告期基金总赎回份额	7,467,626.41
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	258,123,219.59

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,932,905.77
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	4,932,905.77
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.91

§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钻石品质企业混合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混合型证券投资基金之法律意见书

（三）《新华钻石品质企业混合型证券投资基金托管协议》

（四）《新华钻石品质企业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《新华钻石品质企业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

新华中证环保产业指数分级证券投资基金

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	333,225,382.63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，以及因基金的申购和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，通过跟踪标的指数表现，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份额为杠铃收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有