

新华灵活主题混合型证券投资基金
2016 年半年度报告
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：二〇一六年八月二十四日

1 重要提示及目录

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。本半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 8 月 23 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	错误!未定义书签。
2.2 基金产品说明.....	错误!未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人.....	错误!未定义书签。
2.4 信息披露方式.....	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	错误!未定义书签。
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	错误!未定义书签。
3.2 基金净值表现.....	错误!未定义书签。
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	错误!未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	错误!未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	错误!未定义书签。
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	错误!未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	错误!未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	错误!未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	错误!未定义书签。
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	错误!未定义书签。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	错误!未定义书签。
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	错误!未定义书签。
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	错误!未定义书签。
6.2 利润表.....	错误!未定义书签。
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	错误!未定义书签。
6.4 报表附注.....	错误!未定义书签。
7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	错误!未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	错误!未定义书签。
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.5 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	错误!未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	错误!未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	错误!未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.13 投资组合报告附注.....	错误!未定义书签。
8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	错误!未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	错误!未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	错误!未定义书签。
9 开放式基金份额变动.....	42
10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	错误!未定义书签。
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变.....	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	错误!未定义书签。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	错误!未定义书签。
10.8 其他重大事件.....	错误!未定义书签。
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	错误!未定义书签。
12.2 存放地点.....	错误!未定义书签。
12.3 查阅方式.....	错误!未定义书签。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华灵活主题混合型证券投资基金
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
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	93,616,111.32 份

2.2 基金产品说明

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	齐岩	方韡
	联系电话	010-68779688	010-89936330
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		4008198866	95558
传真		010-68779528	010-85230024
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区朝阳门北大街9 号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区朝阳门北大街9 号
邮政编码		400010	100010
法定代表人		陈重	常振明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-2,269,709.69
本期利润	1,392,045.22
加权平均基金份额本期利润	0.0215
本期加权平均净值利润率	1.78%
本期基金份额净值增长率	-15.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	21,800,496.38
期末可供分配基金份额利润	0.2329
期末基金资产净值	121,546,889.86
期末基金份额净值	1.298
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	73.37%

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为分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（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
过去一个月	5.87%	1.54%	-0.32%	0.78%	6.19%	0.76%
过去三个月	1.88%	1.62%	-1.42%	0.81%	3.30%	0.81%
过去六个月	-15.16%	2.84%	-11.93%	1.47%	-3.23%	1.37%
过去一年	-14.00%	2.88%	-22.77%	1.84%	8.77%	1.04%
过去三年	73.20%	2.11%	39.74%	1.47%	33.46%	0.64%
自基金合同生效起至今	73.37%	1.81%	9.74%	1.33%	63.63%	0.48%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数率，债券投资部分的业绩比较基准选择上证国债指数收益率，复合业绩比较基准为 80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

2、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历史走势对比图

(2011 年 7 月 13 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：本基金于 2011 年 7 月 13 日基金合同生效。

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，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着 35 只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华信用增益债券型证券投资基金、新华惠鑫分级债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华阿里一号保本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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华信用增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金和新华健康生活主题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（助理）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	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

	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、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。			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。
--	---	--	--	---

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券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合规守信情况的说明

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 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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理有限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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，市场快速下跌后低位横盘整理，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-15.16%，同期比较基准的增长率为-11.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

二、基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

四、交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

五、监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人中信银行股份有限公司在对新华灵活主题混合型证券投资基金的托

管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对新华灵活主题混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、每万份基金净收益和 7 日年化收益率的计算、基金利润分配、基金费用开支等进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新华基金管理股份有限公司编制和披露的新华灵活主题混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，认为以上内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华灵活主题混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	13,841,524.69	4,635,875.93
结算备付金		259,746.67	507,156.89
存出保证金		78,876.56	253,197.19
交易性金融资产	6.4.7.2	109,826,421.35	37,824,440.77
其中：股票投资		109,826,421.35	37,824,440.77
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	532,208.29

应收利息	6.4.7.3	2,780.98	1,396.08
应收股利		-	-
应收申购款		1,443,353.84	32,910.35
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		125,452,704.09	43,787,185.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		48,493.83	404,372.89
应付赎回款		777,826.70	235,849.39
应付管理人报酬		141,649.48	52,935.97
应付托管费		23,608.25	8,822.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.4	2,682,563.78	2,575,236.38
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	231,672.19	460,835.86
负债合计		3,905,814.23	3,738,053.15
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.6	93,616,111.32	26,174,541.35
未分配利润	6.4.7.7	27,930,778.54	13,874,591.00
所有者权益合计		121,546,889.86	40,049,132.35
负债和所有者权益总计		125,452,704.09	43,787,185.50

6.2 利润表

会计主体：新华灵活主题混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		2,498,367.99	18,786,950.39
1.利息收入		61,242.00	32,313.96
其中：存款利息收入	6.4.7.8	53,611.76	32,313.96
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,630.24	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,247,262.37	31,833,839.58
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-1,490,321.17	31,729,995.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.11	243,058.80	103,844.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	3,661,754.91	-13,148,734.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	22,633.45	69,531.09
减：二、费用		1,106,322.77	2,373,230.56
1. 管理人报酬		580,747.31	398,025.02
2. 托管费		96,791.18	66,337.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.14	189,723.59	1,661,622.98
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.15	239,060.69	247,245.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,392,045.22	16,413,719.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,392,045.22	16,413,719.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华灵活主题混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	26,174,541.35	13,874,591.00	40,049,132.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,392,045.22	1,392,045.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	67,441,569.97	12,664,142.32	80,105,712.29

值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	82,408,292.97	16,139,306.88	98,547,599.85
2.基金赎回款	-14,966,723.00	-3,475,164.56	-18,441,887.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值)	93,616,111.32	27,930,778.54	121,546,889.86
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值)	41,688,857.35	22,119,498.86	63,808,356.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润)	-	16,413,719.83	16,413,719.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列)	69,929,801.27	74,868,484.62	144,798,285.89
其中：1.基金申购款	110,990,092.50	113,633,140.80	224,623,233.30
2.基金赎回款	-41,060,291.23	-38,764,656.18	-79,824,947.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值)	111,618,658.62	113,401,703.31	225,020,361.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：陈重，主管会计工作负责人：张宗友，会计机构负责人：徐端骞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华灵活主题混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2011】798 号文件“关于核准新华灵活主题股票型证券投资基金募集的批复”批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2011 年 6 月 1 日至 7 月 8 日向社会公开募集,募集期间净认购金额为 530,360,314.99 元,认购资金在募集期间产生的利息为 85,388.20 元,并经国富浩华会计师事务所国号验字(2011)第 65 号验资报告予以验证。2011 年 7 月 13 日办理基金备案

手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不设定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《新华灵活主题股票型证券投资基金招募说明书》及《新华灵活主题股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票）、债券、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60—95%，债券投资占基金资产的比例范围为 0—40%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0—20%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0—3%，现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2016 年 8 月 23 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华灵活主题股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致，所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期末未发生差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税字[2005]107 号文《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、自 2008 年 4 月 24 日起执行的《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金, 不属于营业税征收范围, 不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入, 由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额, 依照现行税法规定代扣代缴个人所得税, 暂不征收企业所得税。

(4) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税, 自 2008 年 4 月 24 日起按 0.1% 的税率缴纳。经国务院批准, 财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起, 调整证券(股票)交易印花税征收方式, 将现行的对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券(股票)交易印花税, 调整为单边征税, 即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券(股票)交易印花税, 对受让方不再征税。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	13,841,524.69
定期存款	-
其他存款	-
合计	13,841,524.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	105,046,777.77	109,826,421.35	4,779,643.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	105,046,777.77	109,826,421.35	4,779,643.58

6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	2,628.58
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	152.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	2,780.98

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,682,563.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,682,563.78

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,930.95
其他应付款	-
预提费用	228,741.24
合计	231,672.19

6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,174,541.35	26,174,541.35
本期申购	82,408,292.97	82,408,292.97
本期赎回（以“-”号填列）	-14,966,723.00	-14,966,723.00
本期末	93,616,111.32	93,616,111.32

6.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,406,193.38	6,468,397.62	13,874,591.00
本期利润	-2,269,709.69	3,661,754.91	1,392,045.22
本期基金份额交易产生的变动数	16,664,012.69	-3,999,870.37	12,664,142.32
其中：基金申购款	20,276,460.01	-4,137,153.13	16,139,306.88
基金赎回款	-3,612,447.32	137,282.76	-3,475,164.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,800,496.38	6,130,282.16	27,930,778.54

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	50,064.22
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,520.28
其他	1,027.26
合计	53,611.76

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	50,177,555.37
减：卖出股票成本总额	51,667,876.54
买卖股票差价收入	-1,490,321.17

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资。

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	0.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应收利息总额	-
买卖债券差价收入	-

注：本基金本报告期无债券投资。

6.4.7.10.3 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资。

6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	243,058.80

基金投资产生的股利收益	-
合计	243,058.80

6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	3,661,754.91
——股票投资	3,661,754.91
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	3,661,754.91

6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	21,036.89
转换费收入	1,596.56
合计	22,633.45

6.4.7.14 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	189,723.59
银行间市场交易费用	-
合计	189,723.59

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	188,959.68
债券账户维护费	6,000.00

汇划手续费	4,319.45
其他	-
合计	239,060.69

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间，均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	580,747.31	398,025.02
其中：支付销售机构的客户维护费	118,233.17	151,587.22

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额，上年度可比期间列示的支付销售机构的客户维护费为当期支付金额。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	96,791.18	66,337.51

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期末与关联方进行银行债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	13,841,524.69	50,064.22	6,382,296.23	20,775.53

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期间无收益分配事项。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002805	丰元股份	2016-06-29	-	网下中签	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
603016	新宏泰	2016-06-23	-	网下中签	8.49	8.49	574.00	4,873.26	4,873.26	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002452	长高集团	2016-06-14	筹划重大事项	12.02	2016-07-12	10.82	26,800.00	316,761.74	322,136.00	-
300265	通光线缆	2016-03-24	筹划重大事项	12.38	2016-07-21	12.55	15,000.00	250,802.00	185,700.00	-
002127	南极电商	2016-05-16	筹划重大事项	9.63	-	-	21,200.00	226,819.00	204,156.00	-
002134	天津普林	2016-05-09	筹划重大事项	14.50	2016-07-29	13.26	7,900.00	125,520.98	114,550.00	-

002249	大洋电机	2016-06-08	筹划重大事项	11.97	2016-07-28	10.77	37,300.00	341,317.78	446,481.00	-
002512	达华智能	2016-06-21	筹划重大事项	20.28	2016-07-21	19.38	16,400.00	324,948.94	332,592.00	-
002686	亿利达	2016-04-20	筹划重大事项	13.54	2016-07-14	14.89	10,800.00	185,184.50	146,232.00	-
300038	梅泰诺	2015-12-16	筹划重大事项	50.58	-	-	20,400.00	877,916.00	1,031,832.00	-
300166	东方国信	2016-06-08	筹划重大事项	27.47	-	-	28,000.00	636,423.24	769,160.00	-
300466	赛摩电气	2016-06-27	筹划重大事项	29.86	-	-	18,300.00	444,246.47	546,438.00	-
002175	东方网络	2016-05-09	筹划重大事项	46.09	-	-	10,500.00	504,989.00	483,945.00	-
600843	上工申贝	2016-02-18	筹划重大事项	13.71	2016-07-26	15.08	2,400.00	31,183.78	32,904.00	-
000802	北京文化	2016-06-01	筹划重大事项	23.52	2016-08-22	21.86	26,600.00	674,142.00	625,632.00	-
002654	万润科技	2016-05-09	筹划重大事项	15.57	-	-	42,851.00	572,542.14	667,190.07	-
300061	康耐特	2016-05-05	筹划重大事项	28.84	2016-07-21	31.56	6,800.00	160,679.00	196,112.00	-
300441	鲍斯股份	2016-04-01	筹划重大事项	26.63	2016-08-12	23.97	42,300.00	904,397.00	1,126,449.00	-
002245	中南文化	2016-06-14	筹划重大事项	22.99	-	-	40,500.00	836,438.61	931,095.00	-
300451	创业软件	2016-05-30	筹划重大事项	44.41	-	-	9,000.00	398,136.00	399,690.00	-
600455	博通股份	2016-05-05	筹划重大事项	49.14	-	-	22,400.00	1,071,161.29	1,100,736.00	-
000955	欣龙控股	2016-04-08	筹划重大事项	8.55	2016-08-10	9.00	36,900.00	332,100.00	315,495.00	-
002255	三七互娱	2016-03-10	筹划重大事项	18.10	2016-08-16	19.91	14,000.00	285,306.64	253,400.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而

发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,841,524.69	-	-	-	13,841,524.69
结算备付金	259,746.67	-	-	-	259,746.67
存出保证金	78,876.56	-	-	-	78,876.56
交易性金融资产	-	-	-	109,826,421.35	109,826,421.35
应收利息	-	-	-	2,780.98	2,780.98
应收申购款	-	-	-	1,443,353.84	1,443,353.84
资产总计	14,180,147.92	-	-	111,272,556.17	125,452,704.09
负债					
应付证券清算款	-	-	-	48,493.83	48,493.83
应付赎回款	-	-	-	777,826.70	777,826.70
应付管理人报酬	-	-	-	141,649.48	141,649.48
应付托管费	-	-	-	23,608.25	23,608.25
应付交易费用	-	-	-	2,682,563.78	2,682,563.78
其他负债	-	-	-	231,672.19	231,672.19
负债总计	-	-	-	3,905,814.23	3,905,814.23
利率敏感度缺口	14,180,147.92	-	-	107,366,741.94	121,546,889.86

上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,635,875.93	-	-	-	4,635,875.93
结算备付金	507,156.89	-	-	-	507,156.89
存出保证金	253,197.19	-	-	-	253,197.19
交易性金融资产	-	-	-	37,824,440.77	37,824,440.77
应收证券清算款	-	-	-	532,208.29	532,208.29
应收利息	-	-	-	1,396.08	1,396.08
应收申购款	-	-	-	32,910.35	32,910.35
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	5,396,230.01	-	-	38,390,955.49	43,787,185.50
负债					
应付证券清算款	-	-	-	404,372.89	404,372.89
应付赎回款	-	-	-	235,849.39	235,849.39
应付管理人报酬	-	-	-	52,935.97	52,935.97
应付托管费	-	-	-	8,822.66	8,822.66
应付交易费用	-	-	-	2,575,236.38	2,575,236.38
其他负债	-	-	-	460,835.86	460,835.86
负债总计	-	-	-	3,738,053.15	3,738,053.15
利率敏感度缺口	5,396,230.01	-	-	34,652,902.34	40,049,132.35

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点		
	其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	增加约 4	增加约 1
	市场利率下降 25.00 bp	减少约 4	减少约 1

注：本基金管理人运用 XRisk Suite 风险控制系统对本基金投资组合中的银行存款、结算备付金、存出保证金和债券类资产做出以上利率风险的敏感性分析

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	109,826,421.35	90.36	37,824,440.77	94.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	109,826,421.35	90.36	37,824,440.77	94.45

注：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60-95%，债券投资占基金资产的比例范围为 0-40%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0-20%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%，现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。截至期末，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,本基金业绩比较基准上升 1%	
	其他市场变量不变,本基金业绩比较基准下降 1%	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	本基金业绩比较基准上升 1%	增加约 156	增加约 41
	本基金业绩比较基准下降 1%	减少约 156	减少约 41

注：1. 本基金的整体业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×80% + 上证国债指数收益率×20%；

2. 本基金管理人运用 XRISK SUITE 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价格风险的敏感性分析。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	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
11	300441	鲍斯股份	42,300	1,126,449.00	0.93
12	300144	宋城演艺	44,700	1,113,477.00	0.92
13	600455	博通股份	22,400	1,100,736.00	0.91
14	000858	五粮液	33,700	1,096,261.00	0.90
15	600978	宜华生活	95,600	1,064,984.00	0.88
16	300038	梅泰诺	20,400	1,031,832.00	0.85
17	600850	华东电脑	33,800	969,722.00	0.80
18	002339	积成电子	52,500	957,600.00	0.79
19	300231	银信科技	51,100	942,284.00	0.78
20	600519	贵州茅台	3,201	934,435.92	0.77
21	002445	中南文化	40,500	931,095.00	0.77
22	300113	顺网科技	24,270	921,289.20	0.76
23	300367	东方网力	36,500	906,295.00	0.75
24	000810	创维数字	49,501	894,483.07	0.74
25	300159	新研股份	49,400	891,670.00	0.73
26	002251	步步高	67,540	875,993.80	0.72
27	300369	绿盟科技	20,200	854,662.00	0.70
28	002285	世联行	108,680	846,617.20	0.70
29	002119	康强电子	40,200	822,492.00	0.68
30	002519	银河电子	36,200	811,604.00	0.67
31	300033	同花顺	9,500	773,775.00	0.64
32	300166	东方国信	28,000	769,160.00	0.63
33	000997	新大陆	38,300	767,532.00	0.63
34	002112	三变科技	29,900	766,337.00	0.63
35	300212	易华录	25,400	756,158.00	0.62
36	600048	保利地产	86,300	744,769.00	0.61
37	300304	云意电气	23,000	737,840.00	0.61
38	300379	东方通	9,168	728,672.64	0.60
39	300302	同有科技	22,410	727,652.70	0.60
40	300291	华录百纳	30,900	727,077.00	0.60
41	300182	捷成股份	41,500	710,065.00	0.58
42	600260	凯乐科技	43,000	703,480.00	0.58
43	300285	国瓷材料	17,600	702,064.00	0.58
44	300036	超图软件	28,600	700,700.00	0.58
45	300165	天瑞仪器	64,400	697,452.00	0.57
46	600735	新华锦	49,700	697,291.00	0.57
47	002094	青岛金王	26,100	697,131.00	0.57
48	002131	利欧股份	40,300	688,727.00	0.57
49	002343	慈文传媒	14,100	683,850.00	0.56
50	002654	万润科技	42,851	667,190.07	0.55
51	300170	汉得信息	43,200	655,776.00	0.54
52	300072	三聚环保	23,166	640,308.24	0.53
53	300418	昆仑万维	22,380	632,682.60	0.52

54	002624	完美环球	16,600	626,650.00	0.52
55	000797	中国武夷	41,900	625,986.00	0.52
56	000802	北京文化	26,600	625,632.00	0.51
57	601801	皖新传媒	52,400	611,508.00	0.50
58	002657	中科金财	11,100	609,834.00	0.50
59	002290	禾盛新材	21,900	609,477.00	0.50
60	300133	华策影视	38,640	601,624.80	0.49
61	300295	三六五网	18,500	601,250.00	0.49
62	600809	山西汾酒	26,200	581,116.00	0.48
63	300059	东方财富	26,000	577,200.00	0.47
64	002009	天奇股份	35,200	574,816.00	0.47
65	600701	*ST 工新	42,992	567,064.48	0.47
66	600570	恒生电子	8,400	560,868.00	0.46
67	300466	赛摩电气	18,300	546,438.00	0.45
68	300188	美亚柏科	20,400	543,456.00	0.45
69	002439	启明星辰	21,000	542,430.00	0.45
70	600756	浪潮软件	17,925	539,542.50	0.44
71	603901	永创智能	29,800	535,804.00	0.44
72	600298	安琪酵母	30,000	535,200.00	0.44
73	002777	久远银海	4,400	532,400.00	0.44
74	600503	华丽家族	57,600	528,192.00	0.43
75	600055	华润万东	29,920	525,395.20	0.43
76	600880	博瑞传播	61,200	520,812.00	0.43
77	600883	博闻科技	35,800	519,458.00	0.43
78	002256	彩虹精化	15,600	511,680.00	0.42
79	000615	京汉股份	26,800	491,780.00	0.40
80	000860	顺鑫农业	20,400	485,112.00	0.40
81	002175	东方网络	10,500	483,945.00	0.40
82	002396	星网锐捷	24,500	482,650.00	0.40
83	002776	柏堡龙	13,200	469,392.00	0.39
84	600831	广电网络	35,800	463,968.00	0.38
85	300097	智云股份	9,026	451,751.30	0.37
86	300382	斯莱克	12,000	450,960.00	0.37
87	002249	大洋电机	37,300	446,481.00	0.37
88	600641	万业企业	34,200	443,574.00	0.36
89	300354	东华测试	16,500	443,025.00	0.36
90	300031	宝通科技	17,357	442,950.64	0.36
91	603686	龙马环卫	12,100	441,287.00	0.36
92	600980	北矿科技	15,001	433,528.90	0.36
93	300015	爱尔眼科	11,800	431,054.00	0.35
94	002444	巨星科技	21,200	430,784.00	0.35
95	300192	科斯伍德	33,800	430,274.00	0.35
96	600593	大连圣亚	13,500	418,365.00	0.34
97	002643	万润股份	8,000	407,040.00	0.33

98	600522	DR 中天科	41,500	406,700.00	0.33
99	002717	岭南园林	13,500	403,110.00	0.33
100	300451	创业软件	9,000	399,690.00	0.33
101	300400	劲拓股份	11,000	397,870.00	0.33
102	002165	红宝丽	42,100	393,214.00	0.32
103	002284	亚太股份	20,500	391,345.00	0.32
104	600287	江苏舜天	42,700	389,851.00	0.32
105	300279	和晶科技	8,100	384,669.00	0.32
106	000848	承德露露	32,000	382,400.00	0.31
107	300380	安硕信息	7,400	381,100.00	0.31
108	600446	金证股份	10,600	381,070.00	0.31
109	600207	安彩高科	36,801	376,474.23	0.31
110	600423	柳化股份	56,001	375,206.70	0.31
111	600615	丰华股份	20,800	372,112.00	0.31
112	600713	南京医药	42,400	357,008.00	0.29
113	603000	人民网	21,400	355,454.00	0.29
114	600887	伊利股份	21,300	355,071.00	0.29
115	300398	飞凯材料	4,700	351,560.00	0.29
116	000632	三木集团	40,900	349,695.00	0.29
117	002534	杭锅股份	32,750	348,787.50	0.29
118	002053	云南盐化	12,200	346,358.00	0.28
119	603939	益丰药房	10,600	345,772.00	0.28
120	300251	光线传媒	29,300	338,708.00	0.28
121	603019	中科曙光	8,500	338,470.00	0.28
122	600362	江西铜业	25,100	338,348.00	0.28
123	300496	中科创达	4,994	338,193.68	0.28
124	002235	安妮股份	18,500	336,885.00	0.28
125	000687	华讯方舟	17,000	336,600.00	0.28
126	600588	用友网络	17,000	332,860.00	0.27
127	002512	达华智能	16,400	332,592.00	0.27
128	002224	三力士	14,300	331,045.00	0.27
129	300243	瑞丰高材	20,100	329,640.00	0.27
130	000501	鄂武商 A	21,000	329,490.00	0.27
131	000985	大庆华科	13,200	326,436.00	0.27
132	002535	林州重机	40,240	325,139.20	0.27
133	600750	江中药业	10,200	324,360.00	0.27
134	600486	扬农化工	11,800	323,320.00	0.27
135	601689	拓普集团	9,800	322,910.00	0.27
136	002452	长高集团	26,800	322,136.00	0.27
137	300119	瑞普生物	19,800	317,790.00	0.26
138	002304	洋河股份	4,400	316,448.00	0.26
139	000955	欣龙控股	36,900	315,495.00	0.26
140	600322	天房发展	70,600	314,876.00	0.26
141	601519	大智慧	33,800	310,622.00	0.26

142	600562	国睿科技	9,000	308,610.00	0.25
143	002113	天润控股	10,000	307,900.00	0.25
144	600560	金白天正	18,400	303,048.00	0.25
145	600126	杭钢股份	50,000	300,000.00	0.25
146	300029	天龙光电	22,800	296,400.00	0.24
147	002671	龙泉股份	24,000	296,400.00	0.24
148	601933	永辉超市	71,700	296,121.00	0.24
149	300386	飞天诚信	8,900	295,213.00	0.24
150	002527	新时达	18,600	293,880.00	0.24
151	600099	林海股份	24,600	289,542.00	0.24
152	300249	依米康	29,250	288,990.00	0.24
153	000150	宜华健康	9,200	286,856.00	0.24
154	002533	金杯电工	21,200	284,716.00	0.23
155	000692	惠天热电	50,700	282,906.00	0.23
156	300001	特锐德	12,900	279,801.00	0.23
157	600158	中体产业	15,700	278,675.00	0.23
158	601699	潞安环能	42,600	278,604.00	0.23
159	600826	兰生股份	10,600	277,508.00	0.23
160	600052	浙江广厦	40,200	276,576.00	0.23
161	600348	阳泉煤业	43,200	275,184.00	0.23
162	600962	国投中鲁	20,000	273,400.00	0.22
163	300207	欣旺达	10,600	272,102.00	0.22
164	300422	博世科	8,200	271,748.00	0.22
165	600760	*ST 黑豹	31,193	270,443.31	0.22
166	601233	桐昆股份	24,300	263,898.00	0.22
167	002464	金利科技	4,300	262,730.00	0.22
168	002537	海立美达	8,600	261,440.00	0.22
169	300078	思创医惠	7,800	260,832.00	0.21
170	002055	得润电子	8,500	260,270.00	0.21
171	300020	银江股份	13,800	256,680.00	0.21
172	000525	红太阳	19,500	255,060.00	0.21
173	603558	健盛集团	13,500	254,745.00	0.21
174	600302	标准股份	30,300	254,520.00	0.21
175	600992	贵绳股份	20,600	254,410.00	0.21
176	002555	三七互娱	14,000	253,400.00	0.21
177	000681	视觉中国	10,700	253,055.00	0.21
178	000971	高升控股	10,108	251,891.36	0.21
179	300365	恒华科技	5,500	251,625.00	0.21
180	600373	中文传媒	12,100	251,075.00	0.21
181	002004	华邦健康	27,400	250,162.00	0.21
182	000881	大连国际	11,000	242,770.00	0.20
183	300311	任子行	11,101	242,223.82	0.20
184	002137	麦达数字	14,200	240,832.00	0.20
185	000703	恒逸石化	24,400	240,828.00	0.20

186	002653	海思科	14,900	238,698.00	0.20
187	002188	巴士在线	8,200	237,226.00	0.20
188	002301	齐心集团	11,500	235,750.00	0.19
189	300467	迅游科技	3,801	235,205.88	0.19
190	002171	楚江新材	13,500	232,605.00	0.19
191	002078	太阳纸业	47,601	232,292.88	0.19
192	600702	沱牌舍得	9,200	232,208.00	0.19
193	300286	安科瑞	7,800	231,582.00	0.19
194	002192	融捷股份	6,250	230,937.50	0.19
195	300250	初灵信息	7,770	229,914.30	0.19
196	000616	海航投资	42,300	225,882.00	0.19
197	002038	双鹭药业	7,400	223,332.00	0.18
198	002655	共达电声	13,800	222,870.00	0.18
199	000815	美利纸业	10,700	222,346.00	0.18
200	300168	万达信息	8,500	220,915.00	0.18
201	600730	中国高科	15,400	217,602.00	0.18
202	600136	当代明诚	9,200	212,980.00	0.18
203	300247	乐金健康	25,500	211,650.00	0.17
204	600520	*ST 中发	11,000	205,920.00	0.17
205	300150	世纪瑞尔	18,900	204,687.00	0.17
206	002127	南极电商	21,200	204,156.00	0.17
207	600165	新日恒力	15,300	202,266.00	0.17
208	002143	印纪传媒	8,600	201,498.00	0.17
209	000697	炼石有色	8,700	198,795.00	0.16
210	300061	康耐特	6,800	196,112.00	0.16
211	000558	莱茵体育	11,800	195,172.00	0.16
212	000799	酒鬼酒	8,100	192,780.00	0.16
213	002475	立讯精密	9,650	189,622.50	0.16
214	300265	通光线缆	15,000	185,700.00	0.15
215	603598	引力传媒	7,600	182,780.00	0.15
216	000702	正虹科技	13,800	181,608.00	0.15
217	002467	二六三	11,300	174,133.00	0.14
218	600306	*ST 商城	13,197	167,074.02	0.14
219	600315	上海家化	5,600	161,504.00	0.13
220	002588	史丹利	13,000	160,550.00	0.13
221	002410	广联达	10,800	154,440.00	0.13
222	300309	吉艾科技	11,600	154,048.00	0.13
223	002338	奥普光电	2,500	153,625.00	0.13
224	600257	大湖股份	13,800	153,594.00	0.13
225	300148	天舟文化	9,960	151,491.60	0.12
226	002155	湖南黄金	11,400	150,138.00	0.12
227	300252	金信诺	4,500	149,085.00	0.12
228	000929	兰州黄河	10,000	147,700.00	0.12
229	002686	亿利达	10,800	146,232.00	0.12

230	603636	南威软件	2,100	144,900.00	0.12
231	000628	高新发展	10,800	142,884.00	0.12
232	002230	科大讯飞	4,000	131,400.00	0.11
233	002584	西陇科学	9,350	124,448.50	0.10
234	002134	天津普林	7,900	114,550.00	0.09
235	002571	德力股份	7,000	112,700.00	0.09
236	002667	鞍重股份	3,600	109,764.00	0.09
237	002104	恒宝股份	6,500	106,860.00	0.09
238	300121	阳谷华泰	7,700	105,413.00	0.09
239	600386	北巴传媒	5,300	98,898.00	0.08
240	300100	双林股份	2,100	92,001.00	0.08
241	000678	襄阳轴承	11,600	91,640.00	0.08
242	300364	中文在线	1,200	62,400.00	0.05
243	600843	上工申贝	2,400	32,904.00	0.03
244	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
245	603016	新宏泰	574	4,873.26	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002251	步步高	3,260,898.69	8.14
2	002292	奥飞娱乐	1,881,830.00	4.70
3	000983	西山煤电	1,743,185.40	4.35
4	300339	润和软件	1,708,164.20	4.27
5	600362	江西铜业	1,555,403.00	3.88
6	002609	捷顺科技	1,526,242.00	3.81
7	300287	飞利信	1,511,990.00	3.78
8	300075	数字政通	1,500,398.90	3.75
9	600519	贵州茅台	1,424,466.20	3.56
10	300352	北信源	1,346,050.00	3.36
11	300377	赢时胜	1,255,342.50	3.13
12	300253	卫宁健康	1,227,309.20	3.06
13	600978	宜华生活	1,202,018.54	3.00
14	002339	积成电子	1,193,720.95	2.98
15	002119	康强电子	1,158,741.00	2.89
16	600048	保利地产	1,089,120.00	2.72
17	000858	五粮液	1,078,379.87	2.69
18	300348	长亮科技	1,062,305.00	2.65
19	600880	博瑞传播	1,060,390.50	2.65

20	002285	世联行	1,028,043.50	2.57
21	000810	创维数字	1,024,745.00	2.56
22	300367	东方网力	1,012,829.00	2.53
23	600850	华东电脑	1,003,774.00	2.51
24	300369	绿盟科技	946,493.00	2.36
25	300113	顺网科技	945,550.00	2.36
26	300231	银信科技	938,741.00	2.34
27	600887	伊利股份	926,731.00	2.31
28	300144	宋城演艺	858,061.00	2.14
29	000848	承德露露	852,211.30	2.13
30	002519	银河电子	844,048.52	2.11
31	300291	华录百纳	842,921.27	2.10
32	002131	利欧股份	803,221.60	2.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002251	步步高	2,837,704.76	7.09
2	600362	江西铜业	1,209,189.60	3.02
3	600880	博瑞传播	954,696.52	2.38
4	300104	乐视网	927,670.92	2.32
5	002292	奥飞娱乐	828,923.00	2.07
6	300075	数字政通	775,600.00	1.94
7	300327	中颖电子	693,564.00	1.73
8	002609	捷顺科技	647,449.60	1.62
9	600257	大湖股份	621,420.13	1.55
10	002625	龙生股份	618,901.34	1.55
11	600887	伊利股份	613,029.98	1.53
12	600519	贵州茅台	610,853.70	1.53
13	000599	青岛双星	593,546.00	1.48
14	000810	创维数字	576,470.67	1.44
15	600165	新日恒力	529,693.00	1.32
16	000848	承德露露	519,073.00	1.30
17	300188	美亚柏科	507,993.00	1.27
18	600641	万业企业	507,137.00	1.27
19	002590	万安科技	489,568.88	1.22
20	300024	机器人	488,035.00	1.22

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	120,008,102.21
卖出股票的收入（成交）总额	50,177,555.37

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.6.1 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。

7.6.2 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。

7.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.7.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末尚无国债期货投资政策。

7.7.2 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。

7.7.3 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 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。

7.8.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

7.8.4 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
2,570	36,426.50	63,301,017.43	67.62%	30,315,093.89	32.38%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	65,033.57	0.07%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0-10 万份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 7 月 13 日）基金份额总额	530,445,703.19
本报告期期初基金份额总额	26,174,541.35
本报告期基金总申购份额	82,408,292.97
减：本报告期基金总赎回份额	14,966,723.00
本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

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 3 月 24 日，崔建波先生担任基金管理人副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	120,545,650.05	70.84%	88,155.34	70.84%	-
广发证券	1	34,299,566.71	20.16%	25,083.21	20.16%	-
平安证券	1	15,329,935.76	9.01%	11,210.61	9.01%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金报告期内共租用4个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

- 3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	124,000,000.00	100.00%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2015 年年度资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-04
2	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金 2016 年 1 月 4 日开放时间的公告	公司网站	2016-01-04
3	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-06
4	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金 2016 年 1 月 7 日开放时间的公告	公司网站	2016-01-07
5	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-12
6	新华灵活主题混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-22
7	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-27
8	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-28
9	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-29

10	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中证金牛为代销机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-02-18
11	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中信期货有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-02-19
12	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-01
13	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为代销机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-01
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在国泰君安证券开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-12
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加金观诚为代销机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-15
16	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-25
17	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加新兰德开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-26
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加众禄基金开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-28
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-03-29
20	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰为销售机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-04-16
21	新华基金管理股份有限公司关于“银联通”渠道开通部分银行借记卡网上直销业务功能的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-04-20
22	新华灵活主题混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-04-21
23	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-04-25
24	新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销系统招商银行网银支付费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、	2016-04-29

		公司网站	
25	新华基金管理股份有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-05-05
26	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-06-06
27	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-06-13
28	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-06-13

11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华灵活主题股票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股票型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华灵活主题股票型证券投资基金托管协议
- (四) 新华灵活主题股票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
- (十) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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

二〇一六年八月二十四日