

**新华趋势领航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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 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

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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。
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	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。
<b>4 管理人报告</b> .....	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。
<b>5 托管人报告</b> .....	13
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。
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
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。
<b>7 投资组合报告</b> .....	33
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。
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	45
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。
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
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。
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>50</b>
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>50</b>
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	新华趋势领航混合型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	1,040,294,394.34 份

### 2.2 基金产品说明

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，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	洪渊
	联系电话	010-68779688	010-66105799
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95588
传真		010-68779528	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街55 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	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		400010	100140

法定代表人	陈重	易会满
-------	----	-----

## 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	-41,879,924.53
本期利润	-203,554,252.57
加权平均基金份额本期利润	-0.2147
本期加权平均净值利润率	-10.69%
本期基金份额净值增长率	-11.43%
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	857,039,390.06
期末可供分配基金份额利润	0.8238
期末基金资产净值	2,209,958,957.91
期末基金份额净值	2.124
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	112.40%

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未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	3.66%	1.18%	-0.32%	0.78%	3.98%	0.40%
过去三个月	2.61%	1.25%	-1.42%	0.81%	4.03%	0.44%
过去六个月	-11.43%	2.06%	-11.93%	1.47%	0.50%	0.59%
过去一年	-12.99%	2.36%	-22.77%	1.84%	9.78%	0.52%
过去三年	112.39%	1.78%	27.01%	1.49%	85.38%	0.29%
自基金合同生效起至今	112.40%	1.78%	27.01%	1.49%	85.39%	0.29%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中证内地消费主题指数，债券投资部分的业绩比较基准选择上证国债指数，复合业绩比较基准为： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

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

新华趋势领航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

(2013 年 9 月 11 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：本基金于 2013 年 9 月 11 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		
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	2013-09-11	-	21	经济学硕士，历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、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。				
--	-------------	--	--	--	--

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趋势领航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》、《新华趋势领航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 年上半年市场维持先暴跌后企稳回升，板块和个股涨跌分化非常大，部分强势板块如 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、计算机、房地产等板块下跌幅度较大。上半年上证综指下跌 17.2%，创业板指下跌 17.9%，新华趋势领航基金下跌 11.43%，跌幅略好于主板和创业板，保持中性仓位。板块配置方面，重点配置房地产、机械、化工、汽车、计算机、农林牧渔等板块。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 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.124 元，本报告期份额净值增长率为-11.43%，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

预计 2016 年 3 季度经济将弱势整理。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，创业板估值仍然较高，监管趋严导致市场活跃度下降，重组趋严导致外延并购难度加大，理财资金入市新规可能造成理财资金外流，外延扩张和内生增长减速导致新兴产业个股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，指数调整幅度不会太大，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 季度末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）等板块的机会。小市值壳资源仍然可以布局，但需要耐心等待机会。3 季度将关注深港通出台时间、SDR 实施以及 G20 会议。

#### 4.6 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询；
- 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

本报告期末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净值低于五千万元的情形。

### 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，本基金托管人在对新华趋势领航混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，新华趋势领航混合型证券投资基金的管理人——新华基金管理股份有限公司在新华趋势领航混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新华趋势领航混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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趋势领航股票证券投资基金 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，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2016 年 8 月 19 日

## 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：新华趋势领航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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	582,471,242.67	389,261,765.53
结算备付金		2,138,209.62	5,199,861.45
存出保证金		708,913.33	805,710.12
交易性金融资产	6.4.7.2	1,645,247,674.84	1,620,877,440.20
其中：股票投资		1,643,377,293.77	1,620,877,440.20
基金投资		-	-
债券投资		1,870,381.07	-
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		651,102.06	-
应收利息	6.4.7.3	112,791.95	59,135.58
应收股利		-	-
应收申购款		1,477,280.60	32,969,731.95
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,232,807,215.07</b>	<b>2,049,173,644.83</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		-	-
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		9,483,185.69	56,244,799.94
应付赎回款		6,957,346.26	11,149,772.86
应付管理人报酬		2,589,209.97	2,443,927.20
应付托管费		431,535.02	407,321.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.4	3,148,392.06	5,523,739.15
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	238,588.16	485,005.93
<b>负债合计</b>		<b>22,848,257.16</b>	<b>76,254,566.30</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.6	1,040,294,394.34	822,828,966.99
未分配利润	6.4.7.7	1,169,664,563.57	1,150,090,111.54
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,209,958,957.91</b>	<b>1,972,919,078.53</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,232,807,215.07</b>	<b>2,049,173,644.83</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.124 元，基金份额总额 1,040,294,394.34 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华趋势领航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
<b>一、收入</b>		<b>-182,298,810.74</b>	<b>445,742,690.46</b>
1.利息收入		1,867,374.20	383,546.87

其中：存款利息收入	6.4.7.8	1,865,664.29	383,546.87
债券利息收入		1,709.91	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-23,836,001.72	278,544,272.92
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-31,774,831.28	275,452,959.40
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	7,938,829.56	3,091,313.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	-161,674,328.04	162,721,179.18
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	1,344,144.82	4,093,691.49
<b>减：二、费用</b>		<b>21,255,441.83</b>	<b>12,515,068.62</b>
1. 管理人报酬		14,184,018.29	7,476,062.43
2. 托管费		2,364,003.06	1,246,010.41
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.14	4,470,840.03	3,556,749.77
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	236,580.45	236,246.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-203,554,252.57</b>	<b>433,227,621.84</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-203,554,252.57</b>	<b>433,227,621.84</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华趋势领航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）	822,828,966.99	1,150,090,111.54	1,972,919,078.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-203,554,252.57	-203,554,252.57



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）	217,465,427.35	223,128,704.60	440,594,131.95
其中：1.基金申购款	560,348,262.96	551,569,416.86	1,111,917,679.82
2.基金赎回款	-342,882,835.61	-328,440,712.26	-671,323,547.87
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）	1,040,294,394.34	1,169,664,563.57	2,209,958,957.91
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）	455,739,829.77	147,694,829.27	603,434,659.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	433,227,621.84	433,227,621.84
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）	235,251,797.06	414,781,554.05	650,033,351.11
其中：1.基金申购款	600,140,509.23	868,289,356.01	1,468,429,865.24
2.基金赎回款	-364,888,712.17	-453,507,801.96	-818,396,514.13
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）	690,991,626.83	995,704,005.16	1,686,695,631.99

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

新华趋势领航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[2013]905 号文件“关于核准新华趋势领航混合型证券投资基金募集的批复”，由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于 2013 年 8 月 12 日至 9 月 6 日向社会公开募集，首次

募集资金总额 757,627,065.19 元，其中募集净认购资金金额 757,319,667.23 元，募集资金产生利息 307,397.96 元，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2013]第 404A0011 号验资报告予以验证。2013 年 9 月 11 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新华趋势领航混合型证券投资基金招募说明书》及《新华趋势领航混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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（但须符合中国证监会的相关规定）。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%。

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 2015 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 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华趋势领航混合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一致，所采用的会计政策与最近一期年度报告一致。

#### **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

本基金报告期内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	582,471,242.67
定期存款	-
其他存款	-
合计	582,471,242.67

#### 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	1,692,512,135.60	1,643,377,293.77	-49,134,841.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,289,500.00	1,870,381.07
	银行间市场	-	-
	合计	1,289,500.00	1,870,381.07
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,693,801,635.60	1,645,247,674.84	-48,553,960.76

#### 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	109,928.96
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	1,153.08
应收债券利息	1,709.91
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	112,791.95

注：本项应收结算备付金利息中包含了应收保证金利息。

#### 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	3,148,392.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,148,392.06

**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	9,846.92
其他应付款	-
预提费用	228,741.24
合计	238,588.16

**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	822,828,966.99	822,828,966.99
本期申购	560,348,262.96	560,348,262.96
本期赎回（以“-”号填列）	-342,882,835.61	-342,882,835.61
本期末	1,040,294,394.34	1,040,294,394.34

**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	717,148,797.00	432,941,314.54	1,150,090,111.54
本期利润	-41,879,924.53	-161,674,328.04	-203,554,252.57
本期基金份额交易产生的变动数	181,770,517.59	41,358,187.01	223,128,704.60
其中：基金申购款	469,923,107.19	81,646,309.67	551,569,416.86
基金赎回款	-288,152,589.60	-40,288,122.66	-328,440,712.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	857,039,390.06	312,625,173.51	1,169,664,563.57

**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	1,833,710.34
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	31,953.95
其他	-
合计	1,865,664.29

注：本项应收结算备付金利息中包含了应收保证金利息。

**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	1,452,614,162.52
减：卖出股票成本总额	1,484,388,993.80
买卖股票差价收入	-31,774,831.28

**6.4.7.10 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	7,938,829.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,938,829.56

**6.4.7.11 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	-161,674,328.04
——股票投资	-162,255,209.11
——债券投资	580,881.07
——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	-161,674,328.04
----	-----------------

**6.4.7.12 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	1,342,236.28
转换费收入	1,908.54
合计	1,344,144.82

**6.4.7.13 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	4,470,840.03
银行间市场交易费用	-
合计	4,470,840.03

**6.4.7.14 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	4,500.00
汇划手续费	3,339.21
其他	-
合计	236,580.45

**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**

截至财务报告签发日，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
中国工商银行股份有限公司	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
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

**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**

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
恒泰证券	221,505,222.79	7.11%	4,048,069.88	0.15%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本报告期本基金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**

本报告期本基金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**

本报告期本基金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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
恒泰证券	161,986.84	5.91%	777,977.88	0.25%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣



	佣金	总量的比例		金总额的比例
恒泰证券	2,875.72	0.13%	151,688.24	3.49%

#### 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	14,184,018.29	7,476,062.43
其中：支付销售机构的客户维护费	2,754,194.50	905,191.20

注：1、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。

2、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。

##### 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	2,364,003.06	1,246,010.41

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间债券(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
中国工商银行	582,471,242.67	1,833,710.34	340,841,482.83	363,202.17

#### 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	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-19	网下中签	12.98	12.98	12,601.00	163,560.98	163,560.98	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-21	网下中签	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-

##### 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
600497	驰宏锌锗	2016-06-09	筹划非公开发行股票	9.97	2016-07-11	10.97	250,000.00	2,532,769.00	2,492,500.00	-
600768	宁波富邦	2016-03-31	筹划重大事项停牌	24.42	-	-	100,000.00	2,247,878.00	2,442,000.00	-

600455	博通股份	2016-05-05	重大资产重组事项停牌	49.14	-	-	155,300.00	4,267,693.24	7,631,442.00	-
000524	岭南控股	2016-04-04	重大资产重组事项停牌	13.08	-	-	700,000.00	12,842,176.49	9,156,000.00	-
000710	天兴仪表	2016-06-15	重大资产重组事项停牌	22.12	-	-	30,700.00	781,698.75	679,084.00	-
300166	东方国信	2016-06-08	重大资产重组事项停牌	27.47	-	-	204,300.00	6,419,044.30	5,612,121.00	-
300385	雪浪环境	2016-06-21	重大资产重组事项停牌	35.67	2016-07-05	37.38	108,100.00	3,607,047.00	3,855,927.00	-
000953	河池化工	2016-04-11	重大资产重组事项停牌	13.51	2016-07-12	12.16	150,000.00	1,563,050.00	2,026,500.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项停牌	8.29	-	-	300,000.00	2,833,932.05	2,487,000.00	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大资产重组事项停牌	19.22	-	-	250,000.00	4,476,903.00	4,805,000.00	-
000975	银泰资源	2016-04-19	重大资产重组事项停牌	15.00	-	-	300,000.00	3,144,432.94	4,500,000.00	-
002591	恒大高新	2016-04-15	重大资产重组事项停牌	17.78	-	-	201,458.00	3,314,211.50	3,581,923.24	-
002686	亿利达	2016-04-20	重大资产重组事项停牌	13.54	2016-07-14	14.89	275,200.00	3,900,402.13	3,726,208.00	-
000004	国农科技	2016-03-24	重大资产重组事项停	36.83	-	-	665,491.00	21,306,438.50	24,510,033.53	-

			牌							
002059	云南旅游	2016-06-01	重大资产重组事项停牌	8.56	-	-	350,000.00	3,369,692.00	2,996,000.00	-
002316	键桥通讯	2016-05-25	重大资产重组事项停牌	12.41	-	-	242,700.00	4,896,464.00	3,011,907.00	-

### 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等级的证券，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。

**6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
AAA	0.00	-
AAA 以下	1,289,500.00	-
未评级	0.00	-
合计	1,289,500.00	-

**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。

**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	582,471,242.67	-	-	-	582,471,242.67
结算备付金	2,138,209.62	-	-	-	2,138,209.62
存出保证金	708,913.33	-	-	-	708,913.33
交易性金融资产	1,870,381.07	-	-	1,643,377,293.77	1,645,247,674.84
应收证券清算款	-	-	-	651,102.06	651,102.06
应收利息	-	-	-	112,791.95	112,791.95
应收申购款	-	-	-	1,477,280.60	1,477,280.60
资产总计	587,188,746.69	-	-	1,645,618,468.38	2,232,807,215.07
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,483,185.69	9,483,185.69
应付赎回款	-	-	-	6,957,346.26	6,957,346.26
应付管理人报酬	-	-	-	2,589,209.97	2,589,209.97
应付托管费	-	-	-	431,535.02	431,535.02
应付交易费用	-	-	-	3,148,392.06	3,148,392.06
其他负债	-	-	-	238,588.16	238,588.16
负债总计	-	-	-	22,848,257.16	22,848,257.16
利率敏感度缺口	587,188,746.69	-	-	1,622,770,211.22	2,209,958,957.91
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	389,261,765.53	-	-	-	389,261,765.53
结算备付金	5,199,861.45	-	-	-	5,199,861.45
存出保证金	805,710.12	-	-	-	805,710.12
交易性金融资产	-	-	-	1,620,877,440.20	1,620,877,440.20
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	59,135.58	59,135.58
应收申购款	-	-	-	32,969,731.95	32,969,731.95
资产总计	395,267,337.10	-	-	1,653,906,307.73	2,049,173,644.83

					83
负债					
应付证券清算款	-	-	-	56,244,799.94	56,244,799.94
应付赎回款	-	-	-	11,149,772.86	11,149,772.86
应付管理人报酬	-	-	-	2,443,927.20	2,443,927.20
应付托管费	-	-	-	407,321.22	407,321.22
应付交易费用	-	-	-	5,523,739.15	5,523,739.15
其他负债	-	-	-	485,005.93	485,005.93
负债总计	-	-	-	76,254,566.30	76,254,566.30
利率敏感度缺口	395,267,337.10	-	-	1,577,651,741.43	1,972,919,078.53

#### 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 147	增加约 99
	市场利率下降 25.00 bp	减少约 147	减少约 99

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，所面临的最大的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	1,643,377,293.77	74.36	1,620,877,440.20	82.16
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,870,381.07	0.08	-	-
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	1,645,247,674.84	74.45	1,620,877,440.20	82.16

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%。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 2,306	增加约 1,934
	本基金业绩比较基准下降 1%	减少约 2,306	减少约 1,934

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	1,643,377,293.77	73.60
	其中：股票	1,643,377,293.77	73.60
2	固定收益投资	1,870,381.07	0.08
	其中：债券	1,870,381.07	0.08
	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	584,609,452.29	26.18
7	其他各项资产	2,950,087.94	0.13
8	合计	2,232,807,215.07	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	30,902,332.06	1.40
B	采矿业	31,132,277.52	1.41
C	制造业	968,797,569.36	43.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,279,960.40	1.96
E	建筑业	8,835,810.50	0.40
F	批发和零售业	88,346,920.49	4.00

G	交通运输、仓储和邮政业	9,730,345.49	0.44
H	住宿和餐饮业	9,156,000.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	131,052,522.30	5.93
J	金融业	73,588,495.02	3.33
K	房地产业	229,414,615.17	10.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,032,157.46	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	6,095,000.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	454,900.00	0.02
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	10,558,388.00	0.48
	合计	1,643,377,293.77	74.36

### 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	300119	瑞普生物	3,207,671	51,483,119.55	2.33
2	000797	中国武夷	2,606,363	38,939,063.22	1.76
3	002510	天汽模	3,503,834	29,151,898.88	1.32
4	600050	中国联通	6,800,000	25,908,000.00	1.17
5	000004	国农科技	665,491	24,510,033.53	1.11
6	000581	威孚高科	1,208,573	24,364,831.68	1.10
7	600257	大湖股份	2,006,140	22,328,338.20	1.01
8	600266	北京城建	1,756,600	21,939,934.00	0.99
9	600584	长电科技	1,077,400	21,860,446.00	0.99
10	600246	万通地产	4,057,806	20,694,810.60	0.94
11	002133	广宇集团	3,100,000	19,964,000.00	0.90
12	600486	扬农化工	700,000	19,180,000.00	0.87
13	300123	太阳鸟	1,356,550	19,045,962.00	0.86
14	002662	京威股份	1,250,000	18,887,500.00	0.85
15	300088	长信科技	1,225,000	18,215,750.00	0.82
16	600048	保利地产	2,000,000	17,260,000.00	0.78
17	600476	湘邮科技	600,300	16,922,457.00	0.77
18	600883	博闻科技	1,150,800	16,698,108.00	0.76
19	600028	中国石化	3,505,991	16,548,277.52	0.75

20	000783	长江证券	1,350,000	15,660,000.00	0.71
21	000822	山东海化	3,014,801	15,285,041.07	0.69
22	603678	火炬电子	199,926	15,238,359.72	0.69
23	600340	华夏幸福	600,000	14,628,000.00	0.66
24	600278	东方创业	900,300	13,999,665.00	0.63
25	002191	劲嘉股份	1,150,000	13,328,500.00	0.60
26	603268	松发股份	332,700	13,284,711.00	0.60
27	601688	华泰证券	700,500	13,253,460.00	0.60
28	600886	国投电力	2,000,000	13,200,000.00	0.60
29	600079	人福医药	783,500	13,139,295.00	0.59
30	600007	中国国贸	650,000	13,130,000.00	0.59
31	000785	武汉中商	1,150,000	12,822,500.00	0.58
32	600213	亚星客车	1,000,000	12,760,000.00	0.58
33	002123	荣信股份	609,006	12,661,234.74	0.57
34	600992	贵绳股份	1,006,538	12,430,744.30	0.56
35	600718	东软集团	650,000	11,908,000.00	0.54
36	002074	国轩高科	300,000	11,841,000.00	0.54
37	600689	上海三毛	752,200	11,456,006.00	0.52
38	603308	应流股份	450,000	11,313,000.00	0.51
39	600536	中国软件	449,960	11,213,003.20	0.51
40	002671	龙泉股份	859,950	10,620,382.50	0.48
41	000001	平安银行	1,211,946	10,543,930.20	0.48
42	300103	达刚路机	554,975	10,378,032.50	0.47
43	002529	海源机械	498,967	10,223,833.83	0.46
44	000523	广州浪奇	935,624	10,170,232.88	0.46
45	600973	宝胜股份	1,288,379	10,152,426.52	0.46
46	300056	三维丝	530,000	9,566,500.00	0.43
47	600225	天津松江	1,589,727	9,554,259.27	0.43
48	600325	华发股份	851,300	9,423,891.00	0.43
49	000615	京汉股份	500,000	9,175,000.00	0.42
50	600887	伊利股份	550,000	9,168,500.00	0.41
51	000524	岭南控股	700,000	9,156,000.00	0.41
52	603766	隆鑫通用	450,700	9,113,154.00	0.41
53	600667	太极实业	900,000	8,991,000.00	0.41
54	600884	杉杉股份	500,000	8,605,000.00	0.39
55	600422	昆药集团	601,800	8,208,552.00	0.37
56	600552	凯盛科技	400,000	8,096,000.00	0.37
57	600570	恒生电子	120,000	8,012,400.00	0.36
58	002126	银轮股份	900,000	7,938,000.00	0.36
59	600684	珠江实业	1,050,000	7,885,500.00	0.36
60	002271	东方雨虹	449,978	7,753,120.94	0.35
61	600605	汇通能源	401,900	7,752,651.00	0.35
62	002675	东诚药业	165,000	7,677,450.00	0.35
63	600455	博通股份	155,300	7,631,442.00	0.35

64	600302	标准股份	903,117	7,586,182.80	0.34
65	002078	太阳纸业	1,549,955	7,563,780.40	0.34
66	000776	广发证券	450,000	7,542,000.00	0.34
67	300231	银信科技	404,600	7,460,824.00	0.34
68	300309	吉艾科技	559,736	7,433,294.08	0.34
69	600313	农发种业	1,427,250	7,378,882.50	0.33
70	600480	凌云股份	500,000	7,050,000.00	0.32
71	600073	上海梅林	600,000	6,870,000.00	0.31
72	600236	桂冠电力	1,001,600	6,730,752.00	0.30
73	002161	远望谷	450,000	6,700,500.00	0.30
74	600835	上海机电	342,200	6,566,818.00	0.30
75	600305	恒顺醋业	551,400	6,352,128.00	0.29
76	600487	亨通光电	500,000	6,290,000.00	0.28
77	600152	维科精华	575,000	6,238,750.00	0.28
78	600458	时代新材	399,967	6,231,485.86	0.28
79	002368	太极股份	175,000	6,217,750.00	0.28
80	600389	江山股份	442,500	6,150,750.00	0.28
81	002583	海能达	509,950	6,139,798.00	0.28
82	002165	红宝丽	650,000	6,071,000.00	0.27
83	600775	南京熊猫	400,000	5,980,000.00	0.27
84	300077	国民技术	300,000	5,940,000.00	0.27
85	600337	美克家居	455,933	5,931,688.33	0.27
86	002142	宁波银行	400,819	5,924,104.82	0.27
87	600557	康缘药业	360,000	5,878,800.00	0.27
88	001979	招商蛇口	409,956	5,841,873.00	0.26
89	002229	鸿博股份	230,000	5,768,400.00	0.26
90	600315	上海家化	200,000	5,768,000.00	0.26
91	600826	兰生股份	219,999	5,759,573.82	0.26
92	601998	中信银行	1,000,000	5,670,000.00	0.26
93	300304	云意电气	175,560	5,631,964.80	0.25
94	300054	鼎龙股份	225,000	5,629,500.00	0.25
95	600520	*ST 中发	300,000	5,616,000.00	0.25
96	300166	东方国信	204,300	5,612,121.00	0.25
97	300352	北信源	300,000	5,601,000.00	0.25
98	600789	鲁抗医药	625,000	5,587,500.00	0.25
99	600376	首开股份	500,000	5,560,000.00	0.25
100	300138	晨光生物	330,000	5,511,000.00	0.25
101	601258	庞大集团	2,000,000	5,500,000.00	0.25
102	600713	南京医药	652,300	5,492,366.00	0.25
103	601555	东吴证券	400,000	5,360,000.00	0.24
104	603009	北特科技	125,050	5,319,627.00	0.24
105	000541	佛山照明	500,000	5,145,000.00	0.23
106	000411	英特集团	277,200	5,125,428.00	0.23
107	600663	陆家嘴	225,000	5,118,750.00	0.23

108	600978	宜华生活	457,881	5,100,794.34	0.23
109	600589	广东榕泰	500,000	5,075,000.00	0.23
110	300263	隆华节能	450,000	5,031,000.00	0.23
111	600588	用友网络	254,000	4,973,320.00	0.23
112	300252	金信诺	150,000	4,969,500.00	0.22
113	600098	广州发展	631,000	4,934,420.00	0.22
114	600268	国电南自	650,000	4,927,000.00	0.22
115	000028	国药一致	75,178	4,894,087.80	0.22
116	600643	爱建集团	500,000	4,885,000.00	0.22
117	600778	友好集团	500,000	4,850,000.00	0.22
118	600077	宋都股份	1,000,000	4,840,000.00	0.22
119	000651	格力电器	250,000	4,805,000.00	0.22
120	600579	天华院	350,000	4,767,000.00	0.22
121	600460	士兰微	600,000	4,758,000.00	0.22
122	601939	建设银行	1,000,000	4,750,000.00	0.21
123	002527	新时达	300,000	4,740,000.00	0.21
124	601799	星宇股份	100,600	4,609,492.00	0.21
125	002394	联发股份	304,469	4,597,481.90	0.21
126	002325	洪涛股份	500,000	4,595,000.00	0.21
127	300224	正海磁材	200,000	4,534,000.00	0.21
128	600560	金白天正	275,000	4,529,250.00	0.20
129	600500	中化国际	499,938	4,519,439.52	0.20
130	600510	黑牡丹	516,489	4,503,784.08	0.20
131	000975	银泰资源	300,000	4,500,000.00	0.20
132	600583	海油工程	650,000	4,491,500.00	0.20
133	600719	大连热电	600,000	4,464,000.00	0.20
134	600270	外运发展	250,001	4,372,517.49	0.20
135	002214	大立科技	350,000	4,315,500.00	0.20
136	002187	广百股份	349,950	4,311,384.00	0.20
137	601588	北辰实业	1,000,000	4,270,000.00	0.19
138	600735	新华锦	300,000	4,209,000.00	0.19
139	002317	众生药业	350,000	4,196,500.00	0.19
140	300121	阳谷华泰	306,059	4,189,947.71	0.19
141	300007	汉威电子	150,000	4,188,000.00	0.19
142	002350	北京科锐	200,000	4,040,000.00	0.18
143	600791	京能置业	575,000	3,996,250.00	0.18
144	300047	天源迪科	200,000	3,990,000.00	0.18
145	600995	文山电力	400,000	3,976,000.00	0.18
146	300065	海兰信	100,000	3,868,000.00	0.18
147	300385	雪浪环境	108,100	3,855,927.00	0.17
148	300045	华力创通	200,000	3,830,000.00	0.17
149	000656	金科股份	1,000,000	3,820,000.00	0.17
150	002482	广田集团	499,975	3,789,810.50	0.17
151	600761	安徽合力	375,000	3,783,750.00	0.17

152	002686	亿利达	275,200	3,726,208.00	0.17
153	000959	首钢股份	1,000,000	3,700,000.00	0.17
154	600195	中牧股份	200,000	3,660,000.00	0.17
155	600686	金龙汽车	247,219	3,641,535.87	0.16
156	300371	汇中股份	100,000	3,598,000.00	0.16
157	002591	恒大高新	201,458	3,581,923.24	0.16
158	300279	和晶科技	75,000	3,561,750.00	0.16
159	300306	远方光电	150,000	3,559,500.00	0.16
160	002609	捷顺科技	200,600	3,528,554.00	0.16
161	000678	襄阳轴承	446,400	3,526,560.00	0.16
162	002023	海特高新	200,000	3,466,000.00	0.16
163	600309	万华化学	200,000	3,460,000.00	0.16
164	603636	南威软件	50,000	3,450,000.00	0.16
165	000404	华意压缩	350,000	3,367,000.00	0.15
166	600590	泰豪科技	250,000	3,365,000.00	0.15
167	600335	国机汽车	300,000	3,363,000.00	0.15
168	002230	科大讯飞	100,000	3,285,000.00	0.15
169	300090	盛运环保	400,000	3,236,000.00	0.15
170	002194	武汉凡谷	250,000	3,195,000.00	0.14
171	600469	风神股份	300,000	3,192,000.00	0.14
172	600688	上海石化	509,915	3,110,481.50	0.14
173	000758	中色股份	400,000	3,100,000.00	0.14
174	600593	大连圣亚	100,000	3,099,000.00	0.14
175	002422	科伦药业	200,000	3,082,000.00	0.14
176	000539	粤电力 A	613,120	3,077,862.40	0.14
177	600303	曙光股份	206,600	3,068,010.00	0.14
178	600243	青海华鼎	300,000	3,060,000.00	0.14
179	600787	中储股份	409,600	3,043,328.00	0.14
180	002316	键桥通讯	242,700	3,011,907.00	0.14
181	002059	云南旅游	350,000	2,996,000.00	0.14
182	600099	林海股份	250,000	2,942,500.00	0.13
183	600603	*ST 兴业	256,300	2,926,946.00	0.13
184	600594	益佰制药	180,000	2,876,400.00	0.13
185	002530	丰东股份	100,000	2,830,000.00	0.13
186	002607	亚夏汽车	245,000	2,815,050.00	0.13
187	600055	华润万东	160,160	2,812,409.60	0.13
188	600289	亿阳信通	200,000	2,798,000.00	0.13
189	002339	积成电子	150,000	2,736,000.00	0.12
190	002376	新北洋	204,400	2,730,784.00	0.12
191	600285	羚锐制药	249,901	2,696,431.79	0.12
192	300188	美亚柏科	100,000	2,664,000.00	0.12
193	000423	东阿阿胶	50,000	2,641,500.00	0.12
194	601689	拓普集团	80,000	2,636,000.00	0.12
195	300477	合纵科技	100,000	2,581,000.00	0.12

196	600328	兰太实业	210,000	2,524,200.00	0.11
197	600112	天成控股	225,000	2,511,000.00	0.11
198	600497	驰宏锌锗	250,000	2,492,500.00	0.11
199	002129	中环股份	300,000	2,487,000.00	0.11
200	000985	大庆华科	100,000	2,473,000.00	0.11
201	600768	宁波富邦	100,000	2,442,000.00	0.11
202	300452	山河药辅	50,000	2,436,000.00	0.11
203	600498	烽火通信	100,000	2,428,000.00	0.11
204	600807	天业股份	200,000	2,424,000.00	0.11
205	601965	中国汽研	250,000	2,402,500.00	0.11
206	300409	道氏技术	50,000	2,392,500.00	0.11
207	002357	富临运业	150,000	2,314,500.00	0.10
208	603338	浙江鼎力	50,000	2,305,000.00	0.10
209	002169	智光电气	100,000	2,275,000.00	0.10
210	300275	梅安森	100,000	2,269,000.00	0.10
211	002100	天康生物	250,000	2,247,500.00	0.10
212	300185	通裕重工	249,940	2,229,464.80	0.10
213	300068	南都电源	100,000	2,186,000.00	0.10
214	300150	世纪瑞尔	200,000	2,166,000.00	0.10
215	300165	天瑞仪器	200,000	2,166,000.00	0.10
216	300331	苏大维格	75,000	2,138,250.00	0.10
217	300319	麦捷科技	73,200	2,109,624.00	0.10
218	603020	爱普股份	90,000	2,060,100.00	0.09
219	600310	桂东电力	250,600	2,057,426.00	0.09
220	002326	永太科技	100,000	2,040,000.00	0.09
221	002444	巨星科技	100,000	2,032,000.00	0.09
222	300029	天龙光电	156,300	2,031,900.00	0.09
223	000953	河池化工	150,000	2,026,500.00	0.09
224	603012	创力集团	149,934	2,012,114.28	0.09
225	600461	洪城水业	150,000	1,947,000.00	0.09
226	300207	欣旺达	75,000	1,925,250.00	0.09
227	000609	绵世股份	150,000	1,924,500.00	0.09
228	603017	中衡设计	99,913	1,895,349.61	0.09
229	000014	沙河股份	100,000	1,852,000.00	0.08
230	002454	松芝股份	100,000	1,818,000.00	0.08
231	000856	*ST 冀装	150,000	1,807,500.00	0.08
232	300159	新研股份	100,000	1,805,000.00	0.08
233	002362	汉王科技	65,000	1,786,850.00	0.08
234	002158	汉钟精机	144,405	1,780,513.65	0.08
235	002420	毅昌股份	200,000	1,740,000.00	0.08
236	600760	*ST 黑豹	200,000	1,734,000.00	0.08
237	600452	涪陵电力	50,000	1,670,500.00	0.08
238	300200	高盟新材	100,000	1,630,000.00	0.07
239	002239	奥特佳	99,902	1,609,421.22	0.07

240	600382	广东明珠	100,000	1,600,000.00	0.07
241	600833	第一医药	100,000	1,583,000.00	0.07
242	600855	航天长峰	50,000	1,565,000.00	0.07
243	600155	宝硕股份	100,088	1,375,209.12	0.06
244	300160	秀强股份	100,000	1,287,000.00	0.06
245	000886	海南高速	200,000	1,286,000.00	0.06
246	600753	东方银星	45,400	1,273,470.00	0.06
247	300400	劲拓股份	34,400	1,244,248.00	0.06
248	000531	穗恒运 A	100,000	1,222,000.00	0.06
249	000759	中百集团	150,000	1,036,500.00	0.05
250	600354	敦煌种业	125,000	1,003,750.00	0.05
251	000910	大亚科技	60,571	935,821.95	0.04
252	002296	辉煌科技	50,000	907,500.00	0.04
253	002160	常铝股份	100,000	876,000.00	0.04
254	000036	华联控股	100,000	821,000.00	0.04
255	000710	天兴仪表	30,700	679,084.00	0.03
256	002599	盛通股份	17,700	634,014.00	0.03
257	600277	亿利洁能	100,000	595,000.00	0.03
258	002305	南国置业	100,000	562,000.00	0.03
259	603377	东方时尚	10,000	454,900.00	0.02
260	002586	围海股份	50,000	451,000.00	0.02
261	002716	金贵银业	19,628	365,080.80	0.02
262	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
263	002788	鹭燕医药	3,663	236,556.54	0.01
264	603868	飞科电器	3,293	194,780.95	0.01
265	300511	雪榕生物	2,872	191,361.36	0.01
266	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.01
267	601966	玲珑轮胎	12,601	163,560.98	0.01
268	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
269	603339	四方冷链	2,793	151,995.06	0.01
270	603779	威龙股份	2,809	117,865.64	0.01
271	603959	百利科技	2,815	116,681.75	0.01
272	002795	永和智控	1,450	98,716.00	0.00
273	002793	东音股份	1,413	91,859.13	0.00
274	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.00
275	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
276	603726	朗迪集团	1,361	68,798.55	0.00
277	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
278	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
279	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
280	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
281	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
282	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
283	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00



284	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	000797	中国武夷	56,437,328.52	2.86
2	300119	瑞普生物	45,369,239.49	2.30
3	002510	天汽模	35,564,141.24	1.80
4	600246	万通地产	25,403,648.49	1.29
5	600257	大湖股份	24,993,818.11	1.27
6	002133	广宇集团	24,675,841.99	1.25
7	600050	中国联通	23,224,000.00	1.18
8	601688	华泰证券	22,364,603.05	1.13
9	600048	保利地产	22,009,247.39	1.12
10	600689	上海三毛	21,895,645.00	1.11
11	600036	招商银行	21,656,273.67	1.10
12	300123	太阳鸟	19,757,268.51	1.00
13	002123	荣信股份	18,120,898.26	0.92
14	000776	广发证券	16,935,057.00	0.86
15	002662	京威股份	16,640,617.36	0.84
16	600486	扬农化工	16,326,470.69	0.83
17	600584	长电科技	15,574,208.99	0.79
18	600030	中信证券	15,312,600.00	0.78
19	000581	威孚高科	14,772,882.10	0.75
20	300077	国民技术	14,158,436.04	0.72

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	601009	南京银行	37,070,608.85	1.88
2	601688	华泰证券	36,909,916.50	1.87
3	601211	国泰君安	34,974,926.34	1.77
4	000779	三毛派神	30,994,833.55	1.57
5	300130	新国都	28,458,334.12	1.44
6	002112	三变科技	27,593,407.91	1.40

7	600036	招商银行	23,567,303.49	1.19
8	002510	天汽模	22,867,071.50	1.16
9	000776	广发证券	21,571,640.03	1.09
10	000797	中国武夷	21,359,774.75	1.08
11	000001	平安银行	20,562,536.00	1.04
12	000918	嘉凯城	19,155,367.20	0.97
13	300116	坚瑞消防	18,914,947.50	0.96
14	601318	中国平安	18,508,055.00	0.94
15	601336	新华保险	18,187,645.26	0.92
16	600030	中信证券	17,250,607.16	0.87
17	002142	宁波银行	16,850,649.47	0.85
18	002341	新纶科技	16,119,805.53	0.82
19	600235	民丰特纸	15,870,445.40	0.80
20	600129	太极集团	15,370,465.47	0.78

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	1,669,144,056.48
卖出股票的收入（成交）总额	1,452,614,162.52

注：本项“买入股票的成本（成立）总额”与“卖出股票的收入（成立）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 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,870,381.07	0.08

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,870,381.07	0.08

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128011	汽模转债	12,895	1,870,381.07	0.08

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 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。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

##### 7.11.3 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。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 金运激光控股股东梁伟及其一致行动人新余全盛通投资管理公司、易淑梅和梁萍因于 2015 年 2 月 5 日至 3 月 7 日违规减持受到湖北证监局警示函

7.12.2 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。

**7.12.3 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	708,913.33
2	应收证券清算款	651,102.06
3	应收股利	-
4	应收利息	112,791.95
5	应收申购款	1,477,280.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,950,087.94

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本报告期末未持有处于转股的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
2	000004	国农科技	24,510,033.53	1.11	重大资产重组

**7.12.6 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。

## 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
18,479	56,296.03	732,204,160.20	70.38%	308,090,234.14	29.62%

### 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	81,605.44	0.01%

### 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（2013 年 9 月 11 日）基金份额总额	757,627,065.19
本报告期期初基金份额总额	822,828,966.99
本报告期基金总申购份额	560,348,262.96
减：本报告期基金总赎回份额	342,882,835.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,040,294,394.34

## 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。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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	
中信万通	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	672,473,665.24	21.58%	626,273.58	22.84%	-
长江证券	1	601,903,949.27	19.32%	560,553.08	20.44%	-
华泰证券	1	416,788,280.27	13.37%	304,796.67	11.12%	-
国信证券	1	367,886,879.74	11.81%	342,611.70	12.50%	-
安信证券	1	226,705,093.70	7.27%	211,130.44	7.70%	-

恒泰证券	2	221,505,222.79	7.11%	161,986.84	5.91%	-
广发证券	1	186,647,179.47	5.99%	173,825.01	6.34%	-
国泰君安	1	174,031,274.14	5.58%	162,074.91	5.91%	-
方正证券	1	113,561,251.52	3.64%	83,047.71	3.03%	-
招商证券	1	58,540,285.43	1.88%	54,518.74	1.99%	-
西南证券	1	50,015,153.56	1.60%	36,576.28	1.33%	-
中信证券	1	26,189,345.92	0.84%	24,390.37	0.89%	-

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》（证监基金字[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 20 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
中信万通	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

## 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	2016-01-14
6	新华趋势领航混合型证券投资基金 2015 年第	中国证券报、证券时报、	2016-01-22



	4 季度报告	上海证券报、证券日报、 公司网站	
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	2016-01-28
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	2016-01-29
9	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
10	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
11	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	2016-02-24
12	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
13	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
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华龙证券股份有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务及参加基金申购、定期定额投资业务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	2016-03-14
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	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、	2016-04-16

	费率优惠活动的公告	公司网站	
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	新华趋势领航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、公司网站	2016-04-29
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趋势领航股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华趋势领航股票型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华趋势领航股票型证券投资基金托管协议
- (四) 新华趋势领航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《新华趋势领航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