

**新华鑫利灵活配置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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

<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> .....	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> .....	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。
<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> .....	44
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>44</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</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	新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新华鑫利灵活配置混合
基金主代码	519165
交易代码	519165
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2014 年 4 月 23 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	200,061,299.87 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极的选股和资产配置策略，在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续增长，并力争为投资者提供稳定的绝对回报。
投资策略	投资策略方面，本基金将以大类资产配置策略为基础，采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率 +50%×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风险中等预期收益品种，预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	林葛
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街69 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28 号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		400010	100031
法定代表人		陈重	周慕冰

## 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	-15,197,738.77
本期利润	-31,854,152.39
加权平均基金份额本期利润	-0.1889
本期加权平均净值利润率	-16.30%
本期基金份额净值增长率	-15.98%
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	47,958,506.77
期末可供分配基金份额利润	0.2397
期末基金资产净值	248,325,802.83
期末基金份额净值	1.241
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	24.10%

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	6.25%	1.69%	-0.07%	0.49%	6.32%	1.20%
过去三个月	2.56%	1.71%	-0.60%	0.50%	3.16%	1.21%
过去六个月	-15.98%	2.82%	-6.64%	0.92%	-9.34%	1.90%
过去一年	-31.17%	2.88%	-12.36%	1.15%	-18.81%	1.73%
自基金合同生效起至今	24.10%	2.32%	30.36%	1.01%	-6.26%	1.31%

注：1、本基金于 2014 年 4 月 23 日成立。

2、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用 50%×沪深 300 指数收益率 +50%×上证国债指数收益率。

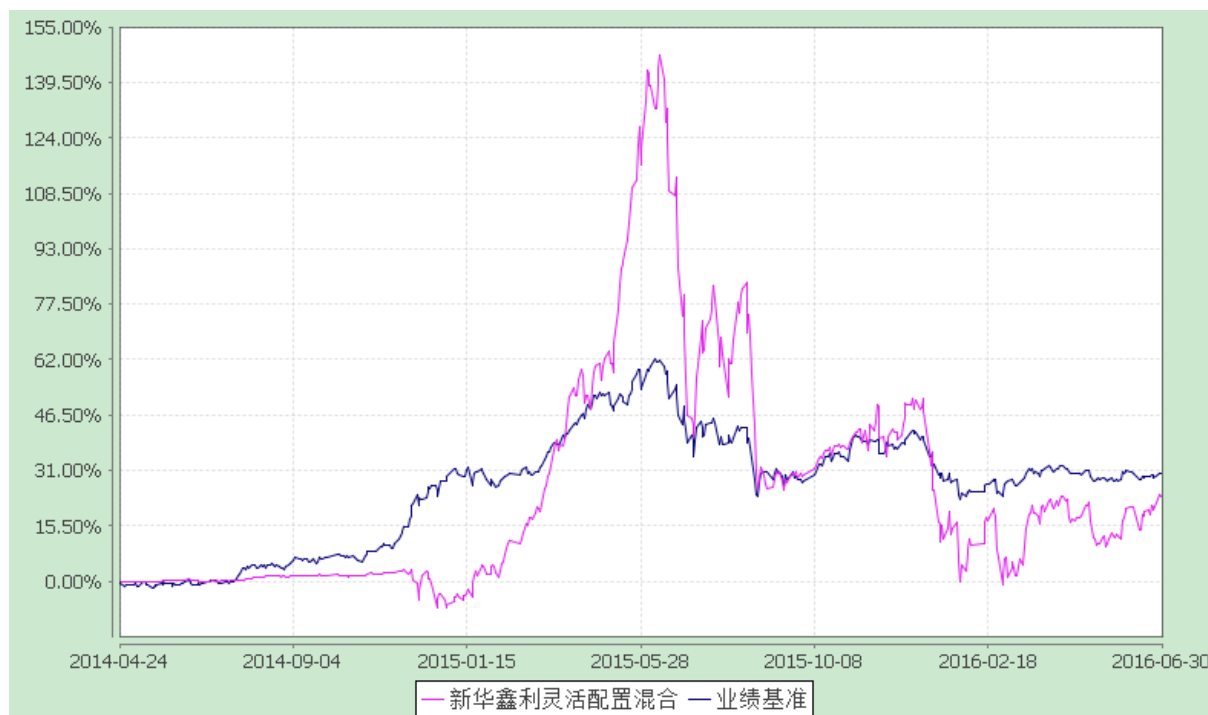
3、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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

新华鑫利灵活配置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

(2014 年 4 月 23 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：1、本基金自 2014 年 4 月 23 日成立。

## 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	2014-12-26	-	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、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鑫利灵活配置混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 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 1.241 元，本报告期份额净值增长率为-15.98%，同期比较基准的增长率为-6.64%。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》

相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

# 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：新华鑫利灵活配置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	23,519,464.39	18,816,190.28
结算备付金		472,602.78	4,493,176.68
存出保证金		121,877.52	948,163.96
交易性金融资产	6.4.7.2	226,658,336.98	187,423,566.03
其中：股票投资		226,658,336.98	187,423,566.03
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		-	24,860,618.73
应收利息	6.4.7.5	4,696.13	4,675.32
应收股利		-	-
应收申购款		23,564.64	80,011,667.11
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>250,800,542.44</b>	<b>316,558,058.11</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		190,462.15	-
应付赎回款		180,963.43	91,871,193.08
应付管理人报酬		295,271.29	300,974.38
应付托管费		49,211.87	50,162.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,529,854.55	2,258,883.27
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	228,976.32	643,161.53
<b>负债合计</b>		<b>2,474,739.61</b>	<b>95,124,374.64</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	200,061,299.87	149,898,945.53
未分配利润	6.4.7.10	48,264,502.96	71,534,737.94
<b>所有者权益合计</b>		<b>248,325,802.83</b>	<b>221,433,683.47</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>250,800,542.44</b>	<b>316,558,058.11</b>

注：注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.241 元基金份额总额:200,061,299.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华鑫利灵活配置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		-29,502,148.91	166,029,797.18

1.利息收入		108,590.44	77,725.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	94,128.89	77,725.21
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		14,461.55	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-12,988,809.08	108,456,129.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-13,506,509.89	107,980,660.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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	6.4.7.14	517,700.81	475,469.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-16,656,413.62	56,561,698.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		34,483.35	934,244.69
<b>减：二、费用</b>		<b>2,352,003.48</b>	<b>4,906,305.01</b>
1. 管理人报酬		1,455,166.59	2,253,914.96
2. 托管费		242,527.73	375,652.49
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	406,938.77	2,037,430.83
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.18	247,370.39	239,306.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-31,854,152.39</b>	<b>161,123,492.17</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-31,854,152.39</b>	<b>161,123,492.17</b>

注：报告截止日:2016年6月30日,基金份额净值1.241元,基金份额总额200,061,299.87份。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华鑫利灵活配置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）	149,898,945.53	71,534,737.94	221,433,683.47

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-31,854,152.39	-31,854,152.39
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）	50,162,354.34	8,583,917.41	58,746,271.75
其中：1.基金申购款	57,870,781.29	10,001,161.45	67,871,942.74
2.基金赎回款	-7,708,426.95	-1,417,244.04	-9,125,670.99
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）	200,061,299.87	48,264,502.96	248,325,802.83
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）	221,892,461.24	-15,188,746.48	206,703,714.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	161,123,492.17	161,123,492.17
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）	-19,842,092.90	16,371,686.53	-3,470,406.37
其中：1.基金申购款	110,647,521.56	96,091,476.61	206,738,998.17
2.基金赎回款	-130,489,614.46	-79,719,790.08	-210,209,404.54
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）	202,050,368.34	162,306,432.22	364,356,800.56

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

新华鑫利灵活配置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[2014]302 号文件“关于核准新华鑫利灵活配置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 2014 年 4 月 8 日至 4 月 18 日向社会公开募集,首次募集资金总额 295,580,861.07 元,其中募集净认购资金金额 295,528,471.14 元,募集资金产生利息 52,389.93 元,并经瑞华会计师事务所有限公司瑞华验字[2014]第 37100015 号验资报告予以验证。2014 年 4 月 23 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,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫利灵活配置混合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、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。本基的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0-95%,单只中小企业私募债券市值不超过基金资产净值的 10%,权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%,现金或者到期日在一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 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》、《新华鑫利灵活配置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**

所采用的会计政策一致,会计估计与最近一期年度报告不一致。

#### **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**

本基金报告期内未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的要求，自 2015 年 3 月 30 日起，本基金对交易所市场上市交易或挂牌转让的除实行全价交易的可转换债券和深交所可交换债券、按成本法估值的私募债和未上市债券品种以外的固定收益品种估值时，由原来的直接采用交易所收盘价估值变更为第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

#### 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	23,519,464.39
定期存款	-
其他存款	-
合计	23,519,464.39

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

**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	235,018,285.18	226,658,336.98	-8,359,948.20
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	235,018,285.18	226,658,336.98	-8,359,948.20

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金报告期末未持有金融衍生资产和负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

本基金报告期末无买入返售金融资产余额。

**6.4.7.5 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	4,455.38
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	240.75
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	0.00
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	4,696.13

注：应收结算备付金利息中包含结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

报告期末，本基金未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 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	1,529,854.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,529,854.55

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

#### 6.4.7.8 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	235.08
其他应付款	-
预提费用	228,741.24
合计	228,976.32

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

#### 6.4.7.9 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	149,898,945.53	149,898,945.53
本期申购	57,870,781.29	57,870,781.29
本期赎回 (以“-”号填列)	-7,708,426.95	-7,708,426.95
本期末	200,061,299.87	200,061,299.87

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

#### 6.4.7.10 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	51,495,033.81	20,039,704.13	71,534,737.94
本期利润	-15,197,738.77	-16,656,413.62	-31,854,152.39
本期基金份额交易产生的变动数	11,661,211.73	-3,077,294.32	8,583,917.41
其中：基金申购款	13,829,963.84	-3,828,802.39	10,001,161.45
基金赎回款	-2,168,752.11	751,508.07	-1,417,244.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,958,506.77	305,996.19	48,264,502.96

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

#### 6.4.7.11 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	84,708.09
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	9,420.80
其他	-
合计	94,128.89

注：结算备付金利息收入中包含结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 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	113,898,093.68
减：卖出股票成本总额	127,404,603.57
买卖股票差价收入	-13,506,509.89

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金报告期无债券投资。

**6.4.7.13.2 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：本基金报告期无债券投资。

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金报告期无债券投资。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金报告期无债券投资。

**6.4.7.14 资产支持证券投资收益**

本基金报告期无资产支持证券投资。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金报告期无贵金属投资。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

本基金报告期无金融衍生工具投资。

**6.4.7.17 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	517,700.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	517,700.81

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

## 6.4.7.18 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	-16,656,413.62
——股票投资	-16,656,413.62
——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	-16,656,413.62

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

## 6.4.7.19 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	31,664.12
转换费收入	2,819.23
合计	34,483.35

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

## 6.4.7.20 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	406,938.77
银行间市场交易费用	-
合计	406,938.77

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

## 6.4.7.21 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	188,959.47
债券账户维护费	13,500.00
汇划手续费	4,949.36
其他	180.00
合计	247,370.39

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

## 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。

## 6.4.9 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
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
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	66,135,291.94	22.25%	240,130,096.00	17.90%

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金报告期无权证交易。



**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金报告期无关联方债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券	-	-	-	-

注：本基金成立于 2014 年 4 月 23 日。

**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	60,071.81	20.56%	687,997.81	45.00%
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	218,614.58	18.01%	244,124.98	15.73%

**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	1,455,166.59	2,253,914.96
其中：支付销售机构的客户维护费	95,743.63	118,350.80

注：1、基金管理人报酬按照前一日基金资产净值的 1.5% 的年费逐日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算方式为：日管理费报酬=前一日基金资产净值\*1.5%/当年天数。

2、本基金于 2014 年 4 月 23 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	242,527.73	375,652.49

注：基金托管人报酬按照前一日基金资产净值的 0.25% 的年费逐日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算方式为：日托管费报酬=前一日基金资产净值\*0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金合同无销售服务费。

#### 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

本基金报告期无银行间市场交易。

#### 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

报告期内无管理人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

报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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
中国农业银行北京万寿支行	23,519,464.39	84,708.09	28,956,705.54	65,062.57

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期内无承销证券的情况。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

### 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	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,436.00	12,191.64	12,191.64	-

注：本基金本报告期无债券投资。

#### 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
000920	南方汇通	2016-02-16	重大资产重组	17.80	2016-07-12	18.10	49,104.00	1,040,741.54	874,051.20	-
002373	千方科技	2016-05-11	重大资产重组	17.12	2016-08-16	16.43	23,234.00	540,969.91	397,766.08	-
600455	博通股份	2016-05-04	重大资产重组	49.14	-	-	26,475.00	1,137,340.33	1,300,981.50	-
600654	中安消	2016-05-18	重大资产重组	18.54	2016-08-08	20.39	16,908.00	562,696.81	313,474.32	-
300061	康耐特	2016-06-23	上市并购重组	28.84	2016-07-21	31.56	14,200.00	357,130.32	409,528.00	-
300441	鲍斯股份	2016-04-05	重大资产重组	26.63	2016-08-12	23.97	32,760.00	576,005.80	872,398.80	-
600634	中技控股	2016-06-21	重大资产重组	14.41	-	-	95,100.00	1,759,537.43	1,370,391.00	-
002512	达华智能	2016-06-20	因追加承诺限售股份上市流	20.28	2016-07-21	19.38	11,400.00	224,816.87	231,192.00	-

			通上市 流通								
002686	亿利达	2016-06-28	重大资产重组	13.54	2016-07-14	14.89	22,800.00	359,930.75	308,712.00	-	
300184	力源信息	2016-03-03	重大资产重组	11.03	-	-	76,800.00	1,289,718.46	847,104.00	-	
002387	黑牛食品	2016-05-24	重大资产重组	16.26	2016-08-03	17.55	135,900.00	2,384,068.98	2,209,734.00	-	
002654	万润科技	2016-05-06	重大事项	15.57	-	-	162,462.00	2,064,867.38	2,529,533.34	-	
002127	南极电商	2016-05-13	筹划重大资产重组	9.63	-	-	42,800.00	460,626.00	412,164.00	-	
002249	大洋电机	2016-06-07	重大资产重组	11.97	2016-07-28	10.77	30,400.00	281,093.37	363,888.00	-	
300038	梅泰诺	2015-12-15	重大资产重组	50.58	-	-	97,300.00	3,981,779.43	4,921,434.00	-	
300166	东方国信	2016-06-07	重大资产重组	27.47	-	-	70,100.00	2,404,451.93	1,925,647.00	-	
600330	天通股份	2016-05-20	重大资产重组	13.93	-	-	39,800.00	481,235.00	554,414.00	-	
300451	创业软件	2016-05-27	重大资产重组	44.41	-	-	7,680.00	342,847.00	341,068.80	-	
300466	赛摩电气	2016-06-24	重大资产重组	29.86	-	-	99,000.00	2,636,728.97	2,956,140.00	-	
002134	天津普林	2016-05-06	重大资产重组	14.50	2016-07-29	13.26	25,300.00	404,608.00	366,850.00	-	
300265	通光线缆	2016-03-23	重大事项	12.38	2016-07-21	12.55	46,000.00	774,490.00	569,480.00	-	

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金报告期末无买入返售资产余额。

#### 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

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。

#### 6.4.13.3 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	23,519,464.39	-	-	-	23,519,464.39
结算备付金	472,602.78	-	-	-	472,602.78
存出保证金	121,877.52	-	-	-	121,877.52
交易性金融资产	-	-	-	226,658,336.98	226,658,336.98
应收利息	-	-	-	4,696.13	4,696.13
应收申购款	-	-	-	23,564.64	23,564.64
资产总计	24,113,944.69	-	-	226,686,597.75	250,800,542.44
负债					
应付证券清算款	-	-	-	190,462.15	190,462.15
应付赎回款	-	-	-	180,963.43	180,963.43
应付管理人报酬	-	-	-	295,271.29	295,271.29
应付托管费	-	-	-	49,211.87	49,211.87
应付交易费用	-	-	-	1,529,854.55	1,529,854.55
其他负债	-	-	-	228,976.32	228,976.32
负债总计	-	-	-	2,474,739.61	2,474,739.61
利率敏感度缺口	24,113,944.69	-	-	224,211,858.14	248,325,802.83
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	18,816,190.28	-	-	-	18,816,190.28
结算备付金	4,493,176.68	-	-	-	4,493,176.68
存出保证金	948,163.96	-	-	-	948,163.96
交易性金融资产	-	-	-	187,423,566.03	187,423,566.03

应收利息	-	-	-	4,675.32	4,675.32
应收申购款	-	-	-	80,011,667.11	80,011,667.11
应收证券清算款	-	-	-	24,860,618.73	24,860,618.73
资产总计	24,257,530.92	-	-	292,300,527.19	316,558,058.11
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	91,871,193.08	91,871,193.08
应付管理人报酬	-	-	-	300,974.38	300,974.38
应付托管费	-	-	-	50,162.38	50,162.38
应付交易费用	-	-	-	2,258,883.27	2,258,883.27
其他负债	-	-	-	643,161.53	643,161.53
负债总计	-	-	-	95,124,374.64	95,124,374.64
利率敏感度缺口	24,257,530.92	-	-	197,176,152.55	221,433,683.47

#### 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 6	增加约 6
	市场利率下降 25.00 bp	减少约 6	减少约 6

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	226,658,336.98	91.27	187,423,566.03	84.64
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	226,658,336.98	91.27	187,423,566.03	84.64

注：本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0-95%，持有单只中小企业私募债券市值不超过基金资产净值的 10%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金或者到期日在一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 322	增加约 205
	本基金业绩比较基准下降 1%	减少约 322	减少约 205

注：1. 本基金的整体业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。



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	226,658,336.98	90.37
	其中：股票	226,658,336.98	90.37
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	23,992,067.17	9.57
7	其他各项资产	150,138.29	0.06
8	合计	250,800,542.44	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	2,885,014.15	1.16
B	采矿业	4,376,420.50	1.76
C	制造业	110,628,905.79	44.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,833,070.72	1.54
E	建筑业	1,119,219.20	0.45
F	批发和零售业	6,847,624.37	2.76

G	交通运输、仓储和邮政业	2,305,163.30	0.93
H	住宿和餐饮业	387,232.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,840,561.92	24.50
J	金融业	1,523,193.00	0.61
K	房地产业	9,229,107.66	3.72
L	租赁和商务服务业	2,764,263.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	1,605,804.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	1,894,652.78	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,379,923.00	0.96
R	文化、体育和娱乐业	10,549,260.02	4.25
S	综合	3,488,921.57	1.40
	合计	226,658,336.98	91.27

### 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	300038	梅泰诺	97,300	4,921,434.00	1.98
2	600570	恒生电子	59,400	3,966,138.00	1.60
3	300075	数字政通	145,455	3,730,920.75	1.50
4	300466	赛摩电气	99,000	2,956,140.00	1.19
5	002171	楚江新材	168,735	2,907,304.05	1.17
6	300159	新研股份	153,200	2,765,260.00	1.11
7	600735	新华锦	186,915	2,622,417.45	1.06
8	002654	万润科技	162,462	2,529,533.34	1.02
9	300339	润和软件	69,900	2,505,216.00	1.01
10	300077	国民技术	117,600	2,328,480.00	0.94
11	002298	中电鑫龙	141,000	2,326,500.00	0.94
12	600242	中昌海运	149,105	2,305,163.30	0.93
13	300213	佳讯飞鸿	80,400	2,270,496.00	0.91
14	000810	创维数字	123,500	2,231,645.00	0.90
15	002387	黑牛食品	135,900	2,209,734.00	0.89
16	000799	酒鬼酒	90,750	2,159,850.00	0.87
17	300377	赢时胜	42,602	2,108,372.98	0.85
18	300144	宋城演艺	84,199	2,097,397.09	0.84
19	300348	长亮科技	55,200	2,040,192.00	0.82

20	600520	*ST 中发	107,800	2,018,016.00	0.81
21	002354	天神娱乐	22,900	1,998,712.00	0.80
22	300113	顺网科技	52,256	1,983,637.76	0.80
23	300496	中科创达	28,715	1,944,579.80	0.78
24	300166	东方国信	70,100	1,925,647.00	0.78
25	603901	永创智能	104,210	1,873,695.80	0.75
26	300302	同有科技	54,330	1,764,095.10	0.71
27	600048	保利地产	199,700	1,723,411.00	0.69
28	300285	国瓷材料	42,723	1,704,220.47	0.69
29	600207	安彩高科	164,000	1,677,720.00	0.68
30	002444	巨星科技	82,400	1,674,368.00	0.67
31	300033	同花顺	20,100	1,637,145.00	0.66
32	000722	湖南发展	117,400	1,623,642.00	0.65
33	300097	智云股份	31,500	1,576,575.00	0.63
34	002284	亚太股份	82,300	1,571,107.00	0.63
35	000005	世纪星源	208,207	1,569,880.78	0.63
36	002624	完美环球	41,495	1,566,436.25	0.63
37	600701	*ST 工新	117,553	1,550,524.07	0.62
38	600306	*ST 商城	121,000	1,531,860.00	0.62
39	600992	贵绳股份	123,358	1,523,471.30	0.61
40	600298	安琪酵母	83,900	1,496,776.00	0.60
41	300243	瑞丰高材	89,892	1,474,228.80	0.59
42	600978	宜华生活	130,400	1,452,656.00	0.58
43	300287	飞利信	107,800	1,444,520.00	0.58
44	600715	文投控股	74,400	1,426,248.00	0.57
45	002251	步步高	109,471	1,419,838.87	0.57
46	002609	捷顺科技	80,371	1,413,725.89	0.57
47	300384	三联虹普	27,400	1,378,220.00	0.56
48	600634	中技控股	95,100	1,370,391.00	0.55
49	002439	启明星辰	52,800	1,363,824.00	0.55
50	300364	中文在线	25,725	1,337,700.00	0.54
51	300015	爱尔眼科	36,300	1,326,039.00	0.53
52	002657	中科金财	23,800	1,307,572.00	0.53
53	600455	博通股份	26,475	1,300,981.50	0.52
54	000858	五粮液	38,900	1,265,417.00	0.51
55	000997	新大陆	62,300	1,248,492.00	0.50
56	600498	烽火通信	51,307	1,245,733.96	0.50
57	603023	威帝股份	62,900	1,211,454.00	0.49
58	300367	东方网力	48,650	1,207,979.50	0.49
59	300426	唐德影视	17,601	1,200,388.20	0.48
60	002477	雏鹰农牧	199,959	1,193,755.23	0.48
61	002113	天润控股	38,700	1,191,573.00	0.48
62	000558	莱茵体育	71,868	1,188,696.72	0.48
63	300063	天龙集团	38,700	1,152,486.00	0.46

64	300352	北信源	60,810	1,135,322.70	0.46
65	600446	金证股份	31,100	1,118,045.00	0.45
66	002339	积成电子	61,200	1,116,288.00	0.45
67	002701	奥瑞金	124,620	1,100,394.60	0.44
68	300170	汉得信息	72,400	1,099,032.00	0.44
69	002343	慈文传媒	22,234	1,078,349.00	0.43
70	300078	思创医惠	31,956	1,068,608.64	0.43
71	000971	高升控股	42,800	1,066,576.00	0.43
72	000150	宜华健康	33,800	1,053,884.00	0.42
73	300468	四方精创	13,900	1,051,813.00	0.42
74	002699	美盛文化	30,832	1,029,480.48	0.41
75	600348	阳泉煤业	159,850	1,018,244.50	0.41
76	002777	久远银海	8,400	1,016,400.00	0.41
77	000673	当代东方	80,400	1,007,412.00	0.41
78	300020	银江股份	54,105	1,006,353.00	0.41
79	600486	扬农化工	36,502	1,000,154.80	0.40
80	002131	利欧股份	58,400	998,056.00	0.40
81	002055	得润电子	32,000	979,840.00	0.39
82	002312	三泰控股	49,800	943,710.00	0.38
83	002643	万润股份	18,500	941,280.00	0.38
84	002304	洋河股份	13,015	936,038.80	0.38
85	000632	三木集团	109,400	935,370.00	0.38
86	600850	华东电脑	32,413	929,928.97	0.37
87	600750	江中药业	29,200	928,560.00	0.37
88	300382	斯莱克	24,553	922,701.74	0.37
89	300036	超图软件	37,500	918,750.00	0.37
90	002467	二六三	58,920	907,957.20	0.37
91	601998	中信银行	158,300	897,561.00	0.36
92	600476	湘邮科技	31,332	883,249.08	0.36
93	000920	南方汇通	49,104	874,051.20	0.35
94	300441	鲍斯股份	32,760	872,398.80	0.35
95	000983	西山煤电	105,500	859,825.00	0.35
96	300369	绿盟科技	20,200	854,662.00	0.34
97	002224	三力士	36,900	854,235.00	0.34
98	002018	华信国际	89,800	853,100.00	0.34
99	300184	力源信息	76,800	847,104.00	0.34
100	002241	歌尔股份	29,500	846,060.00	0.34
101	300279	和晶科技	17,500	831,075.00	0.33
102	600090	啤酒花	66,587	829,674.02	0.33
103	002655	共达电声	50,200	810,730.00	0.33
104	000530	大冷股份	75,000	799,500.00	0.32
105	600562	国睿科技	23,300	798,957.00	0.32
106	002668	奥马电器	13,100	797,397.00	0.32
107	002235	安妮股份	43,750	796,687.50	0.32

108	002325	洪涛股份	85,700	787,583.00	0.32
109	002405	四维图新	31,900	784,740.00	0.32
110	002217	合力泰	51,214	783,574.20	0.32
111	300295	三六五网	23,372	759,590.00	0.31
112	600756	浪潮软件	25,201	758,550.10	0.31
113	300409	道氏技术	15,700	751,245.00	0.30
114	002180	艾派克	26,175	746,772.75	0.30
115	600240	华业资本	74,213	743,614.26	0.30
116	300188	美亚柏科	27,600	735,264.00	0.30
117	002229	鸿博股份	29,300	734,844.00	0.30
118	300467	迅游科技	11,800	730,184.00	0.29
119	002285	世联行	93,240	726,339.60	0.29
120	002503	搜于特	57,660	716,137.20	0.29
121	300212	易华录	24,000	714,480.00	0.29
122	300123	太阳鸟	50,000	702,000.00	0.28
123	603019	中科曙光	17,500	696,850.00	0.28
124	300251	光线传媒	60,000	693,600.00	0.28
125	002165	红宝丽	74,000	691,160.00	0.28
126	002326	永太科技	33,800	689,520.00	0.28
127	000779	三毛派神	30,400	682,480.00	0.27
128	300231	银信科技	36,800	678,592.00	0.27
129	600730	中国高科	47,300	668,349.00	0.27
130	300059	东方财富	30,000	666,000.00	0.27
131	000697	炼石有色	29,100	664,935.00	0.27
132	600165	新日恒力	49,900	659,678.00	0.27
133	603939	益丰药房	20,200	658,924.00	0.27
134	600136	当代明诚	27,999	648,176.85	0.26
135	601699	潞安环能	98,200	642,228.00	0.26
136	002112	三变科技	24,920	638,699.60	0.26
137	000532	力合股份	35,100	637,416.00	0.26
138	002292	奥飞娱乐	20,989	628,620.55	0.25
139	600705	中航资本	106,400	625,632.00	0.25
140	603010	万盛股份	27,800	614,936.00	0.25
141	000815	美利纸业	29,400	610,932.00	0.25
142	002188	巴士在线	21,100	610,423.00	0.25
143	600198	大唐电信	30,500	606,340.00	0.24
144	600395	盘江股份	73,100	603,806.00	0.24
145	002670	华声股份	22,360	603,049.20	0.24
146	002104	恒宝股份	35,900	590,196.00	0.24
147	002155	湖南黄金	44,600	587,382.00	0.24
148	002305	南国置业	104,100	585,042.00	0.24
149	300265	通光线缆	46,000	569,480.00	0.23
150	000687	华讯方舟	28,600	566,280.00	0.23
151	600330	天通股份	39,800	554,414.00	0.22

152	002696	百洋股份	28,853	552,246.42	0.22
153	600883	博闻科技	37,500	544,125.00	0.22
154	002004	华邦健康	59,100	539,583.00	0.22
155	600503	华丽家族	57,500	527,275.00	0.21
156	000797	中国武夷	34,800	519,912.00	0.21
157	000488	晨鸣纸业	65,100	516,894.00	0.21
158	300247	乐金健康	61,100	507,130.00	0.20
159	600962	国投中鲁	37,000	505,790.00	0.20
160	300291	华录百纳	21,200	498,836.00	0.20
161	000892	星美联合	34,900	493,835.00	0.20
162	600386	北巴传媒	26,000	485,160.00	0.20
163	600641	万业企业	37,200	482,484.00	0.19
164	601233	桐昆股份	44,100	478,926.00	0.19
165	601519	大智慧	51,800	476,042.00	0.19
166	000584	友利控股	50,000	475,500.00	0.19
167	600335	国机汽车	42,250	473,622.50	0.19
168	002256	彩虹精化	14,400	472,320.00	0.19
169	300392	腾信股份	17,400	471,192.00	0.19
170	002443	金洲管道	32,700	469,245.00	0.19
171	603636	南威软件	6,800	469,200.00	0.19
172	600055	华润万东	26,560	466,393.60	0.19
173	002594	比亚迪	7,600	463,676.00	0.19
174	002410	广联达	32,300	461,890.00	0.19
175	600360	华微电子	38,900	461,354.00	0.19
176	600990	四创电子	5,300	459,457.00	0.19
177	300286	安科瑞	15,400	457,226.00	0.18
178	000938	紫光股份	7,500	456,600.00	0.18
179	300386	飞天诚信	13,700	454,429.00	0.18
180	300379	东方通	5,700	453,036.00	0.18
181	000702	正虹科技	34,400	452,704.00	0.18
182	600980	北矿科技	15,300	442,170.00	0.18
183	000985	大庆华科	17,800	440,194.00	0.18
184	300433	蓝思科技	15,510	436,141.20	0.18
185	002019	亿帆鑫富	28,150	432,947.00	0.17
186	300001	特锐德	19,717	427,661.73	0.17
187	300178	腾邦国际	21,700	416,640.00	0.17
188	002127	南极电商	42,800	412,164.00	0.17
189	300061	康耐特	14,200	409,528.00	0.16
190	002373	千方科技	23,234	397,766.08	0.16
191	000616	海航投资	73,800	394,092.00	0.16
192	002533	金杯电工	29,300	393,499.00	0.16
193	300249	依米康	39,500	390,260.00	0.16
194	002094	青岛金王	14,500	387,295.00	0.16
195	300278	华昌达	22,000	375,980.00	0.15

196	300253	卫宁健康	15,100	372,970.00	0.15
197	002138	顺络电子	20,300	368,039.00	0.15
198	002134	天津普林	25,300	366,850.00	0.15
199	002249	大洋电机	30,400	363,888.00	0.15
200	300133	华策影视	23,220	361,535.40	0.15
201	002078	太阳纸业	74,000	361,120.00	0.15
202	600313	农发种业	69,550	359,573.50	0.14
203	300363	博腾股份	14,000	347,480.00	0.14
204	300072	三聚环保	12,519	346,025.16	0.14
205	300451	创业软件	7,680	341,068.80	0.14
206	600760	*ST 黑豹	39,300	340,731.00	0.14
207	600060	海信电器	19,200	339,456.00	0.14
208	000592	平潭发展	49,400	334,932.00	0.13
209	600887	伊利股份	20,000	333,400.00	0.13
210	002051	中工国际	16,860	331,636.20	0.13
211	300053	欧比特	18,150	329,422.50	0.13
212	000056	皇庭国际	12,821	326,679.08	0.13
213	300422	博世科	9,800	324,772.00	0.13
214	300304	云意电气	10,100	324,008.00	0.13
215	002519	银河电子	14,300	320,606.00	0.13
216	002153	石基信息	12,100	319,198.00	0.13
217	002571	德力股份	19,800	318,780.00	0.13
218	002086	东方海洋	36,300	317,625.00	0.13
219	600654	中安消	16,908	313,474.32	0.13
220	002686	亿利达	22,800	308,712.00	0.12
221	000678	襄阳轴承	38,700	305,730.00	0.12
222	600373	中文传媒	14,400	298,800.00	0.12
223	601801	皖新传媒	25,500	297,585.00	0.12
224	002487	大金重工	33,100	292,935.00	0.12
225	000703	恒逸石化	29,300	289,191.00	0.12
226	000692	惠天热电	51,734	288,675.72	0.12
227	002308	威创股份	17,100	280,953.00	0.11
228	300175	朗源股份	30,700	277,528.00	0.11
229	002534	杭锅股份	26,000	276,900.00	0.11
230	600522	DR 中天科	27,750	271,950.00	0.11
231	600176	中国巨石	28,340	271,213.80	0.11
232	300311	任子行	12,002	261,883.64	0.11
233	601007	金陵饭店	20,800	260,624.00	0.10
234	000880	潍柴重机	19,089	260,564.85	0.10
235	002667	鞍重股份	8,300	253,067.00	0.10
236	600287	江苏舜天	27,700	252,901.00	0.10
237	600151	航天机电	21,800	246,340.00	0.10
238	600969	郴电国际	16,300	243,033.00	0.10
239	601933	永辉超市	58,800	242,844.00	0.10

240	600615	丰华股份	13,000	232,570.00	0.09
241	002512	达华智能	11,400	231,192.00	0.09
242	002776	柏堡龙	6,400	227,584.00	0.09
243	300380	安硕信息	4,401	226,651.50	0.09
244	002502	骅威文化	9,200	226,320.00	0.09
245	300457	赢合科技	2,802	216,902.82	0.09
246	002338	奥普光电	3,300	202,785.00	0.08
247	300119	瑞普生物	12,400	199,020.00	0.08
248	300192	科斯伍德	15,200	193,496.00	0.08
249	300354	东华测试	6,900	185,265.00	0.07
250	300398	飞凯材料	2,371	177,350.80	0.07
251	002707	众信旅游	8,500	172,550.00	0.07
252	600560	金白天正	9,900	163,053.00	0.07
253	002565	上海绿新	20,762	153,846.42	0.06
254	600322	天房发展	34,000	151,640.00	0.06
255	601689	拓普集团	4,400	144,980.00	0.06
256	600588	用友网络	7,100	139,018.00	0.06
257	000525	红太阳	10,300	134,724.00	0.05
258	002149	西部材料	4,000	127,520.00	0.05
259	600257	太湖股份	11,400	126,882.00	0.05
260	000428	华天酒店	19,300	126,608.00	0.05
261	002053	云南盐化	4,000	113,560.00	0.05
262	002693	双成药业	11,500	108,790.00	0.04
263	300150	世纪瑞尔	9,200	99,636.00	0.04
264	300100	双林股份	2,100	92,001.00	0.04
265	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.04
266	300400	劲拓股份	2,400	86,808.00	0.03
267	300121	阳谷华泰	5,900	80,771.00	0.03
268	603011	合锻智能	5,000	57,800.00	0.02
269	603016	新宏泰	1,436	12,191.64	0.00
270	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	300077	国民技术	3,685,460.00	1.66
2	600048	保利地产	2,837,909.64	1.28
3	600570	恒生电子	2,685,056.90	1.21
4	300496	中科创达	2,670,981.46	1.21



5	000558	莱茵体育	2,448,251.00	1.11
6	000530	大冷股份	2,305,590.20	1.04
7	300075	数字政通	2,197,751.80	0.99
8	603901	永创智能	2,068,388.50	0.93
9	300159	新研股份	2,006,708.00	0.91
10	300348	长亮科技	1,983,293.08	0.90
11	000810	创维数字	1,908,543.00	0.86
12	002625	龙生股份	1,757,705.88	0.79
13	002444	巨星科技	1,752,915.89	0.79
14	600735	新华锦	1,733,225.00	0.78
15	002251	步步高	1,715,880.50	0.77
16	002709	天赐材料	1,680,939.00	0.76
17	600978	宜华生活	1,664,732.00	0.75
18	002624	完美世界	1,660,448.40	0.75
19	300466	赛摩电气	1,658,005.00	0.75
20	300033	同花顺	1,608,231.00	0.73

#### 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	002709	天赐材料	8,284,336.19	3.74
2	002112	三变科技	4,927,557.00	2.23
3	600645	中源协和	4,123,980.00	1.86
4	300075	数字政通	1,944,010.60	0.88
5	603268	松发股份	1,868,336.00	0.84
6	002625	龙生股份	1,785,868.00	0.81
7	002702	海欣食品	1,583,650.26	0.72
8	002590	万安科技	1,573,880.00	0.71
9	300462	华铭智能	1,558,447.88	0.70
10	300468	四方精创	1,546,257.70	0.70
11	001979	招商蛇口	1,493,132.00	0.67
12	300327	中颖电子	1,397,136.00	0.63
13	002308	威创股份	1,319,984.00	0.60
14	300343	联创互联	1,305,283.00	0.59
15	000530	大冷股份	1,206,591.00	0.54
16	300399	京天利	1,194,123.00	0.54
17	002171	楚江新材	1,159,326.00	0.52
18	002654	万润科技	1,125,032.00	0.51
19	300496	中科创达	1,084,849.00	0.49
20	600992	贵绳股份	1,072,473.52	0.48

**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	183,295,788.14
卖出股票的收入（成交）总额	113,898,093.68

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期无债券投资。

**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**

本基金本报告期无债券投资。

**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**

本基金本报告期无资产支持证券投资。

**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**

本基金报告期末无贵金属投资。

**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**

本基金本报告期无权证投资。

**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**

报告期末本基金无股指期货持仓。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金合同无股指期货投资政策。

**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**

本基金合同无国债期货投资政策。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

报告期末本基金无国债期货持仓。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期无国债期货投资

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体本期未出现被监管部门立案调查的情况，也无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票未有超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 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	121,877.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,696.13
5	应收申购款	23,564.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	150,138.29

### 7.12.4 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	300038	梅泰诺	4,921,434.00	1.98	重大资产重组
3	300466	赛摩电气	2,956,140.00	1.19	重大资产重组
4	002654	万润科技	2,529,533.34	1.02	重大事项

### 7.12.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

## 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
2,535	78,919.64	174,145,856.97	87.05%	25,915,442.90	12.95%

### 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	324,464.08	0.16%

### 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
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 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（2014 年 4 月 23 日）基金份额总额	295,580,861.07
本报告期期初基金份额总额	149,898,945.53
本报告期基金总申购份额	57,870,781.29
减：本报告期基金总赎回份额	7,708,426.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	200,061,299.87

## 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。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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	66,135,291.94	22.26%	60,071.81	22.53%	-
招商证券	1	46,694,175.97	15.71%	43,486.19	16.31%	-
国泰君安	1	37,618,166.14	12.66%	35,033.77	13.14%	-
光大证券	1	32,074,801.36	10.79%	29,871.38	11.20%	-
中信建投	1	21,717,304.70	7.31%	19,507.91	7.32%	-
华泰证券	1	19,583,248.18	6.59%	14,321.29	5.37%	-

民生证券	2	13,967,481.40	4.70%	11,091.81	4.16%	-
平安证券	1	11,679,288.71	3.93%	10,877.06	4.08%	-
新时代证券	2	10,401,687.67	3.50%	9,687.14	3.63%	-
中信证券	2	7,171,971.00	2.41%	6,679.29	2.50%	-
银河证券	2	7,137,253.88	2.40%	5,298.98	1.99%	-
国金证券	1	5,525,083.90	1.86%	5,145.67	1.93%	-
齐鲁证券	1	5,308,708.83	1.79%	4,943.97	1.85%	-
东方证券	1	3,373,703.00	1.14%	2,951.46	1.11%	-
申银万国	1	2,505,514.16	0.84%	2,333.45	0.88%	-
兴业证券	1	1,983,195.00	0.67%	1,846.97	0.69%	-
中金公司	1	1,968,989.00	0.66%	1,833.56	0.69%	-
川财证券	1	1,645,299.22	0.55%	1,203.23	0.45%	-
东兴证券	1	673,732.40	0.23%	492.71	0.18%	-

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30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
安信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	30,000,000.00	13.57%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	38,000,000.00	17.19%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	80,000,000.00	36.20%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	73,000,000.00	33.03%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

### 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	2016-01-08
6	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
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	2016-01-14
8	新华鑫利灵活配置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
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	2016-01-27
10	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
11	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
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	2016-02-17
13	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
14	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
15	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



16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	新华鑫利灵活配置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
24	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
25	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
26	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
27	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	2016-06-04
28	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
29	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
30	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	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、	2016-06-13

	公告	公司网站	
--	----	------	--

## 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鑫利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (五) 《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (六) 更新的《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (九) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (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