

新华钻石品质企业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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
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.....	38
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38
8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	40
9 开放式基金份额变动	40
10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	41
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	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件	43
11 影响投资者决策的其他重要信息	45
12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华钻石品质企业混合型证券投资基金
基金简称	新华钻石品质企业混合
基金主代码	519093
交易代码	519093
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月3日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	258,123,219.59 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对上市公司基本面的深入研究，结合宏观经济周期和行业景气度分析，力求在有效控制风险并适度保持良好流动性的前提下，精选具有稳定价值性和高质量成长性的钻石品质类的优质上市公司。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，通过对经济周期、行业特征等宏观层面的信息进行全面分析，调整大类资产配置比例和行业配置比例；在个股个券的选择上采用自下而上的投资策略，核心是从企业价值的稳定性和成长的高质量出发，筛选具有钻石品质的优质企业，并进行重点配置。钻石品质企业股票的配置比例不低于股票资产配置的 80%。钻石品质企业是指具有稳定价值性和高质量成长性的上市公司，它们具有安全、透明、稳定、创新与领导气质五大优秀品质。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	田青
	联系电话	010-68779688	010-67595096
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008198866	010-67595096

传真	010-68779528	010-66275865
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	400010	100033
法定代表人	陈重	王洪章

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
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	中国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	-82,240,352.67
本期利润	-121,775,354.23
加权平均基金份额本期利润	-0.4312
本期加权平均净值利润率	-23.94%
本期基金份额净值增长率	-13.15%
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	234,608,870.39
期末可供分配基金份额利润	0.9089
期末基金资产净值	492,732,089.98
期末基金份额净值	1.909
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	90.90%

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	4.66%	1.21%	-0.32%	0.78%	4.98%	0.43%
过去三个月	3.86%	1.28%	-1.42%	0.81%	5.28%	0.47%
过去六个月	-13.15%	2.20%	-11.93%	1.47%	-1.22%	0.73%
过去一年	-16.05%	2.35%	-22.77%	1.84%	6.72%	0.51%
过去三年	113.06%	1.79%	39.74%	1.47%	73.32%	0.32%
自基金合同生效起至今	90.90%	1.55%	8.91%	1.30%	81.99%	0.25%

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

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华钻石品质企业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

（2010 年 2 月 3 日至 2016 年 6 月 30 日）



注：本基金于 2010 年 2 月 3 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		
付伟	本基金基金经理，新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理。	2016-06-17	-	6	西安交通大学工学硕士，北京大学工商管理硕士，6 年证券从业经验。历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理，新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与 TMT 组组长，先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。现任新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。
贲兴振	本基金基金经理，基金管理部副总监、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-06-08	2016-06-28	9	经济学硕士，9 年证券从业经验。历任北京城市系统工程研究中心研究员。贲兴振先生于 2007 年 9 月加入新华基金管理股份有限公司，先后负责研究煤炭、电力、金融、通信设备、电子和有色金属等行业，担任过策略分析师、债券分析师。历任新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。现任新华基金管理股份有限公司基金管理部副总监。

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

4.3 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

新年伊始，在大非解禁潮和汇率波动的预期影响下，市场经历了两次熔断的巨幅波动。此后，2-3 月迎来一波反弹，二季度市场整体是窄幅震荡的格局。期间上证综指下跌 17.22%，创业板指下

跌 17.92%。本基金维持较中性仓位水平，通过加强精选个股，波段操作，期间净值下跌 13.15%，跑赢上证综指 4.07 个百分点，跑赢创业板指 4.77 个百分点，优于大盘表现。配置方面，行业配置较为均衡，精选各个行业中具有钻石品质的优质上市公司，进行长期投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.909 元，本报告期份额净值增长率为-13.15%，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

整体来看，对于 2016 年我们保持谨慎乐观。预计 2016 年经济仍将弱而不破，上有压力，下有底线。虽然 3 月整体宏观数据略超市场预期，但后续月份数据受房地产和制造业投资拖累，压力再现。货币政策中性偏宽松，降准未来仍有空间。短期联储加息担忧缓解，未来几个月市场处于空窗期，有利于投资者热情恢复。

近期市场更看重成长性确定、估值有优势的标的，我们将会进一步加强对个股基本面的研究，兼顾业绩增长与估值，适度调整相关板块与个股的配置。总体仍将保持中性仓位，均衡配置，精选个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、估值工作小组的职责分工

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

估值工作小组职责：

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

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

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

二、基金会计的职责分工

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

基金会计职责：

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

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部的职责分工

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

四、交易部的职责分工

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

五、监察稽核部的职责分工

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

⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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：新华钻石品质企业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	上年度末
----	-----	-----	------

		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	114,196,319.03	137,720,415.84
结算备付金		1,477,025.64	2,396,964.61
存出保证金		291,119.69	526,509.19
交易性金融资产	6.4.7.2	390,298,792.73	684,838,183.24
其中：股票投资		390,298,792.73	684,838,183.24
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		346,985.96	9,267,821.60
应收利息	6.4.7.5	24,873.08	33,296.47
应收股利		-	-
应收申购款		121,787.45	33,034.71
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		506,756,903.58	834,816,225.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		10,401,048.99	-
应付赎回款		767,630.94	423,720.87
应付管理人报酬		591,298.23	1,058,374.49
应付托管费		98,549.69	176,395.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,975,889.47	2,679,947.49
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	190,396.28	381,489.25
负债合计		14,024,813.60	4,719,927.87
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	258,123,219.59	377,591,622.00
未分配利润	6.4.7.10	234,608,870.39	452,504,675.79
所有者权益合计		492,732,089.98	830,096,297.79

负债和所有者权益总计		506,756,903.58	834,816,225.66
------------	--	-----------------------	-----------------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.909 元，基金份额总额 258,123,219.59 份。

6.2 利润表

会计主体：新华钻石品质企业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		-114,246,213.58	672,867,421.22
1.利息收入		431,239.07	984,914.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	431,239.07	843,058.53
债券利息收入		-	80,694.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	61,161.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-75,328,859.45	830,125,501.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-77,452,168.88	803,991,028.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	13,585,015.62
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	2,123,309.43	12,549,457.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-39,535,001.56	-161,966,347.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	186,408.36	3,723,352.09
减：二、费用		7,529,140.65	24,280,446.72
1. 管理人报酬		3,824,811.22	15,716,611.32
2. 托管费		637,468.51	2,619,435.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	2,863,815.24	5,725,564.50
5. 利息支出		-	10,749.85
其中：卖出回购金融资产支出		-	10,749.85
6. 其他费用	6.4.7.18	203,045.68	208,085.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-121,775,354.23	648,586,974.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-121,775,354.23	648,586,974.50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华钻石品质企业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）	377,591,622.00	452,504,675.79	830,096,297.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-121,775,354.23	-121,775,354.23
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）	-119,468,402.41	-96,120,451.17	-215,588,853.58
其中：1.基金申购款	16,669,563.32	13,227,827.06	29,897,390.38
2.基金赎回款	-136,137,965.73	-109,348,278.23	-245,486,243.96
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）	258,123,219.59	234,608,870.39	492,732,089.98
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）	985,931,415.19	739,744,131.66	1,725,675,546.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	648,586,974.50	648,586,974.50
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）	-500,354,516.41	-769,865,081.95	-1,270,219,598.36
其中：1.基金申购款	1,039,954,732.61	956,343,815.72	1,996,298,548.33
2.基金赎回款	-1,540,309,249.02	-1,726,208,897.67	-3,266,518,146.69
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）	485,576,898.78	618,466,024.21	1,104,042,922.99

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

新华钻石品质企业混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2009]第 1220 号《关于核准新华钻石品质企业混合型证券投资基金募集的批复》核准，由新华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，设立募集期间募集及利息结转的基金份额共 1,937,798,339.14 份，其中募集净认购资金金额 1,936,938,537.27 元，募集资金产生利息 859,801.87 元，业经国富浩华会计师事务所浩华验字【2010】第 8 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金合同》于 2010 年 2 月 3 日正式生效，本基金的基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的各类股票、债券、短期金融工具、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%，其中投资于具有钻石品质企业的股票市值不低于股票投资的 80%。债券、现金类资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%-40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数。

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

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 41 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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政策与上年度一致、会计估计与上年度一致。

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

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	114,196,319.03
定期存款	-
其他存款	-
合计	114,196,319.03

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	384,947,237.27	390,298,792.73	5,351,555.46
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	384,947,237.27	390,298,792.73	5,351,555.46

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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	24,156.95
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	716.13
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	24,873.08

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	1,975,889.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,975,889.47

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	1,436.60
预提审计费	39,781.56
预提信息披露费	149,178.12
预提账户维护费	-
合计	190,396.28

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	377,591,622.00	377,591,622.00
本期申购	16,669,563.32	16,669,563.32
本期赎回（以“-”号填列）	-136,137,965.73	-136,137,965.73
本期末	258,123,219.59	258,123,219.59

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	620,159,703.80	-167,655,028.01	452,504,675.79
本期利润	-82,240,352.67	-39,535,001.56	-121,775,354.23
本期基金份额交易产生的变动数	-183,379,028.97	87,258,577.80	-96,120,451.17
其中：基金申购款	24,172,929.59	-10,945,102.53	13,227,827.06
基金赎回款	-207,551,958.56	98,203,680.33	-109,348,278.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	354,540,322.16	-119,931,451.77	234,608,870.39

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
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	16,069.20
其他	-
合计	431,239.07

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	1,075,852,462.71
减：卖出股票成本总额	1,153,304,631.59
买卖股票差价收入	-77,452,168.88

6.4.7.13 债券投资收益

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	-

6.4.7.14 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	2,123,309.43
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,123,309.43

6.4.7.15 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	-39,535,001.56
——股票投资	-39,535,001.56
——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	-39,535,001.56

6.4.7.16 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	186,262.71
转换费收入	145.65
合计	186,408.36

6.4.7.17 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	2,863,815.24
银行间市场交易费用	-
合计	2,863,815.24

6.4.7.18 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	149,178.12
债券账户维护费	9,000.00
汇划手续费	5,086.00
合计	203,045.68

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
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司	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
恒泰证券股份有限公司	330,953,875.01	16.76%	-	-

注：上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，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

本报告期及上年度可比期间，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

本报告期及上年度可比期间，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
恒泰证券股份有限公司	242,026.66	15.01%	476,104.65	24.10%

注：上年度可比期间，本基金无应支付的关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,824,811.22	15,716,611.32
其中：支付销售机构的客户维护费	853,486.01	2,255,888.52

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

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	637,468.51	2,619,435.22

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未进行银行债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	4,932,905.77	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总	-	-

份额		
期末持有的基金份额	4,932,905.77	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.91%	-

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

本报告期末及上年度末，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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	114,196,319.03	415,169.87	263,633,260.73	819,504.65

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
30052	科大	2016-0	2016-0	网下	10.05	10.05	926.00	9,306.	9,306.	-

0	国创	6-30	7-08	中签				30	30	
---	----	------	------	----	--	--	--	----	----	--

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
600860	京城股份	2016-06-27	筹划重大事项	8.43	2016-07-05	8.85	118,965.00	1,151,207.14	1,002,874.95	-
000802	北京文化	2016-06-01	筹划重大事项	23.52	2016-08-22	21.86	225,484.00	5,186,870.64	5,303,383.68	-
000920	南方汇通	2016-02-17	筹划资产重组	17.80	2016-07-12	18.10	209,148.00	4,470,865.83	3,722,834.40	-
002347	泰尔重工	2016-04-05	筹划重大事项	19.45	2016-07-18	21.40	64,070.00	1,431,029.41	1,246,161.50	-
300332	天壕环境	2016-04-11	拟披露重大事项	9.37	2016-07-29	9.91	58,600.00	496,455.80	549,082.00	-
300166	东方国信	2016-06-08	筹划重大事项	27.47	-	-	62,199.00	1,654,098.61	1,708,606.53	-

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

本基金报告期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场债券正回购。

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。

6.4.13.3 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	114,196,319.03	-	-	-	114,196,319.03
结算备付金	1,477,025.64	-	-	-	1,477,025.64
存出保证金	291,119.69	-	-	-	291,119.69
交易性金融资产	-	-	-	390,298,792.73	390,298,792.73
应收证券清算款	-	-	-	346,985.96	346,985.96
应收利息	-	-	-	24,873.08	24,873.08
应收申购款	-	-	-	121,787.45	121,787.45
资产总计	115,964,464.36	-	-	390,792,439.22	506,756,903.58
负债					
应付证券清算款	-	-	-	10,401,048.99	10,401,048.99
应付赎回款	-	-	-	767,630.94	767,630.94
应付管理人报酬	-	-	-	591,298.23	591,298.23
应付托管费	-	-	-	98,549.69	98,549.69
应付交易费用	-	-	-	1,975,889.47	1,975,889.47
其他负债	-	-	-	190,396.28	190,396.28
负债总计	-	-	-	14,024,813.60	14,024,813.60
利率敏感度缺口	115,964,464.36	-	-	376,767,625.62	492,732,089.98
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	137,720,415.84	-	-	-	137,720,415.84
结算备付金	2,396,964.61	-	-	-	2,396,964.61
存出保证金	526,509.19	-	-	-	526,509.19
交易性金融资产	-	-	-	684,838,183.24	684,838,183.24

					4
应收证券清算款	-	-	-	9,267,821.60	9,267,821.60
应收利息	-	-	-	33,296.47	33,296.47
应收申购款	-	-	-	33,034.71	33,034.71
资产总计	140,643,889.64	-	-	694,172,336.02	834,816,225.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	423,720.87	423,720.87
应付管理人报酬	-	-	-	1,058,374.49	1,058,374.49
应付托管费	-	-	-	176,395.77	176,395.77
应付交易费用	-	-	-	2,679,947.49	2,679,947.49
其他负债	-	-	-	381,489.25	381,489.25
负债总计	-	-	-	4,719,927.87	4,719,927.87
利率敏感度缺口	140,643,889.64	-	-	689,452,408.15	830,096,297.79

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 29	增加约 35
	市场利率下降 25.00 bp	减少约 29	减少约 35

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	390,298,792.73	79.21	684,838,183.24	82.50
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	390,298,792.73	79.21	684,838,183.24	82.50

注：本基金投资组合中股票投资比例范围占基金资产净值的[60%-95%]；其中投资于具有钻石品质上市公司的股票市值不低于股票投资的 80%；债券、现金类资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的[5%-40%]；持有的现金和到期日在一年以内的政府债券的合计比例为[在 5%以上]，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。截至期末，本基金面临的整体市场风险价格风险列示如下：

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%	
	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)		
分析		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 535	增加约 811	
	本基金业绩比较基准下	减少约 535	减少约 811	

	降 1%		
--	------	--	--

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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	390,298,792.73	77.02
	其中：股票	390,298,792.73	77.02
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	115,673,344.67	22.83
7	其他各项资产	784,766.18	0.15
8	合计	506,756,903.58	100.00

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	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	222,836,169.79	45.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,421,494.40	0.69
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,053,060.19	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	2,977,794.80	0.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,519,628.95	10.66
J	金融业	34,949,277.01	7.09
K	房地产业	15,415,088.25	3.13
L	租赁和商务服务业	6,209,441.47	1.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,110,607.05	1.24
O	居民服务、修理和其他服务业	4,285,687.98	0.87
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	27,520,542.84	5.59
S	综合	-	-
	合计	390,298,792.73	79.21

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	601689	拓普集团	280,000	9,226,000.00	1.87
2	002405	四维图新	360,000	8,856,000.00	1.80
3	600887	伊利股份	500,000	8,335,000.00	1.69
4	300364	中文在线	160,085	8,324,420.00	1.69
5	600584	长电科技	400,072	8,117,460.88	1.65
6	300168	万达信息	300,000	7,797,000.00	1.58
7	002329	皇氏集团	500,034	7,495,509.66	1.52
8	002594	比亚迪	120,059	7,324,799.59	1.49
9	002690	美亚光电	300,047	6,913,082.88	1.40
10	000988	华工科技	330,014	6,616,780.70	1.34
11	600422	昆药集团	450,000	6,138,000.00	1.25
12	600643	爱建集团	600,000	5,862,000.00	1.19

13	001979	招商蛇口	383,873	5,470,190.25	1.11
14	000802	北京文化	225,484	5,303,383.68	1.08
15	300198	纳川股份	325,000	5,229,250.00	1.06
16	600074	保千里	349,708	5,217,643.36	1.06
17	300068	南都电源	235,300	5,143,658.00	1.04
18	300263	隆华节能	454,168	5,077,598.24	1.03
19	600735	新华锦	360,023	5,051,122.69	1.03
20	600958	东方证券	300,100	5,044,681.00	1.02
21	000858	五粮液	154,969	5,041,141.57	1.02
22	002273	水晶光电	176,672	4,945,049.28	1.00
23	600418	江淮汽车	388,806	4,930,060.08	1.00
24	600030	中信证券	300,094	4,870,525.62	0.99
25	300379	东方通	60,532	4,811,083.36	0.98
26	300271	华宇软件	254,207	4,809,596.44	0.98
27	300114	中航电测	160,000	4,768,000.00	0.97
28	000776	广发证券	284,365	4,765,957.40	0.97
29	600730	中国高科	337,000	4,761,810.00	0.97
30	601788	光大证券	281,015	4,760,394.10	0.97
31	600337	美克家居	363,469	4,728,731.69	0.96
32	300291	华录百纳	200,072	4,707,694.16	0.96
33	300369	绿盟科技	111,070	4,699,371.70	0.95
34	603338	浙江鼎力	100,594	4,637,383.40	0.94
35	601688	华泰证券	232,547	4,399,789.24	0.89
36	600661	新南洋	152,733	4,285,687.98	0.87
37	002361	神剑股份	528,600	4,101,936.00	0.83
38	300426	唐德影视	60,000	4,092,000.00	0.83
39	002444	巨星科技	199,925	4,062,476.00	0.82
40	002707	众信旅游	200,000	4,060,000.00	0.82
41	000786	北新建材	413,516	3,754,725.28	0.76
42	000920	南方汇通	209,148	3,722,834.40	0.76
43	601933	永辉超市	888,416	3,669,158.08	0.74
44	002439	启明星辰	139,254	3,596,930.82	0.73
45	002368	太极股份	100,000	3,553,000.00	0.72
46	000069	华侨城 A	550,882	3,525,644.80	0.72
47	000488	晨鸣纸业	441,335	3,504,199.90	0.71
48	600718	东软集团	190,146	3,483,474.72	0.71
49	300078	思创医惠	101,300	3,387,472.00	0.69
50	002241	歌尔股份	117,401	3,367,060.68	0.68
51	000910	大亚科技	216,230	3,340,753.50	0.68
52	300274	阳光电源	133,840	3,265,696.00	0.66
53	601519	大智慧	353,131	3,245,273.89	0.66
54	002009	天奇股份	198,134	3,235,528.22	0.66
55	600327	大东方	357,400	3,188,008.00	0.65
56	300367	东方网力	125,776	3,123,018.08	0.63

57	600458	时代新材	200,007	3,116,109.06	0.63
58	002705	新宝股份	197,990	3,092,603.80	0.63
59	002662	京威股份	199,923	3,020,836.53	0.61
60	002711	欧浦智网	199,852	2,977,794.80	0.60
61	000965	天保基建	500,000	2,960,000.00	0.60
62	300452	山河药辅	60,000	2,923,200.00	0.59
63	002343	慈文传媒	60,000	2,910,000.00	0.59
64	000601	韶能股份	274,872	2,872,412.40	0.58
65	000917	电广传媒	167,600	2,770,428.00	0.56
66	600109	国金证券	200,000	2,696,000.00	0.55
67	600199	金种子酒	240,000	2,664,000.00	0.54
68	600184	光电股份	117,023	2,649,400.72	0.54
69	600760	*ST 黑豹	303,000	2,627,010.00	0.53
70	600741	华域汽车	186,430	2,611,884.30	0.53
71	603588	高能环境	94,861	2,584,962.25	0.52
72	600557	康缘药业	157,539	2,572,611.87	0.52
73	601211	国泰君安	143,335	2,549,929.65	0.52
74	601633	长城汽车	300,000	2,532,000.00	0.51
75	600566	济川药业	96,009	2,471,271.66	0.50
76	300119	瑞普生物	145,478	2,334,921.90	0.47
77	000513	丽珠集团	50,400	2,323,944.00	0.47
78	600703	三安光电	113,912	2,274,822.64	0.46
79	603328	依顿电子	76,997	2,274,491.38	0.46
80	002152	广电运通	136,356	2,241,692.64	0.45
81	002078	太阳纸业	455,700	2,223,816.00	0.45
82	600048	保利地产	257,600	2,223,088.00	0.45
83	600136	当代明诚	94,300	2,183,045.00	0.44
84	002400	省广股份	152,119	2,149,441.47	0.44
85	600835	上海机电	109,680	2,104,759.20	0.43
86	601566	九牧王	135,200	2,087,488.00	0.42
87	300252	金信诺	62,650	2,075,594.50	0.42
88	002250	联化科技	144,200	2,064,944.00	0.42
89	002544	杰赛科技	63,393	2,033,013.51	0.41
90	002304	洋河股份	28,259	2,032,387.28	0.41
91	300325	德威新材	100,000	1,860,000.00	0.38
92	600809	山西汾酒	83,438	1,850,654.84	0.38
93	000523	广州浪奇	169,920	1,847,030.40	0.37
94	002366	台海核电	33,300	1,775,223.00	0.36
95	300166	东方国信	62,199	1,708,606.53	0.35
96	000739	普洛药业	269,807	1,675,501.47	0.34
97	002271	东方雨虹	87,852	1,513,689.96	0.31
98	300474	景嘉微	10,000	1,508,700.00	0.31
99	603308	应流股份	56,600	1,422,924.00	0.29
100	300003	乐普医疗	76,600	1,397,184.00	0.28

101	000860	顺鑫农业	53,800	1,279,364.00	0.26
102	002347	泰尔重工	64,070	1,246,161.50	0.25
103	002462	嘉事堂	33,134	1,234,241.50	0.25
104	600826	兰生股份	47,094	1,232,920.92	0.25
105	600476	湘邮科技	40,672	1,146,543.68	0.23
106	000959	首钢股份	286,000	1,058,200.00	0.21
107	600860	京城股份	118,965	1,002,874.95	0.20
108	300332	天壕环境	58,600	549,082.00	0.11
109	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
110	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	600030	中信证券	18,129,313.72	2.18
2	001979	招商蛇口	14,526,966.22	1.75
3	300059	东方财富	13,858,661.24	1.67
4	300369	绿盟科技	13,355,035.05	1.61
5	000802	北京文化	12,542,697.10	1.51
6	300364	中文在线	12,185,117.87	1.47
7	300291	华录百纳	12,085,030.39	1.46
8	600074	保千里	10,771,228.00	1.30
9	300078	思创医惠	10,765,501.50	1.30
10	000786	北新建材	9,623,553.00	1.16
11	000401	冀东水泥	9,552,788.04	1.15
12	300458	全志科技	9,352,634.84	1.13
13	000988	华工科技	9,239,945.92	1.11
14	002690	美亚光电	8,826,030.35	1.06
15	002405	四维图新	8,625,799.00	1.04
16	002586	围海股份	8,570,854.62	1.03
17	000055	方大集团	8,251,561.17	0.99
18	600418	江淮汽车	8,075,094.19	0.97
19	002273	水晶光电	7,972,844.79	0.96
20	002271	东方雨虹	7,954,474.48	0.96

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	601588	北辰实业	14,970,174.91	1.80
2	000786	北新建材	14,794,449.48	1.78
3	300059	东方财富	14,607,867.56	1.76
4	600030	中信证券	13,357,365.13	1.61
5	300458	全志科技	13,250,914.92	1.60
6	300104	乐视网	12,356,466.30	1.49
7	300369	绿盟科技	12,061,982.13	1.45
8	601688	华泰证券	11,747,233.78	1.42
9	601318	中国平安	11,240,574.01	1.35
10	000802	北京文化	11,067,559.08	1.33
11	002308	威创股份	10,237,765.67	1.23
12	002594	比亚迪	10,162,797.76	1.22
13	603019	中科曙光	10,069,748.50	1.21
14	000401	冀东水泥	9,691,382.76	1.17
15	002586	围海股份	9,536,925.44	1.15
16	002271	东方雨虹	9,447,810.68	1.14
17	002273	水晶光电	9,075,304.85	1.09
18	000938	紫光股份	9,006,895.25	1.09
19	001979	招商蛇口	8,946,908.23	1.08
20	600703	三安光电	8,772,177.46	1.06

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	898,300,242.64
卖出股票的收入（成交）总额	1,075,852,462.71

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属。

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

报告期末，本基金未持有权证。

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

本报告期末本基金尚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

本报告期末本基金尚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

本报告期末本基金未持有国债期货。

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 2015 年 10 月 16 日，中文在线（300364）高级管理人员宋洁，违反《上市公司董事、监事、和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》等相关规定违规通过竞价交易方式卖出公司股票 2000 股成交均价 125.8 元，行为在本人不知悉情况下由其亲属操作，受到监管部门的警告和公司相关处罚。此事项并不影响本基金的投资决策。

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

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之外的股票。

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

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

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
12,072	21,381.98	97,504,895.10	37.77%	160,618,324.49	62.23%

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	111,561.36	0.04%

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	10~50
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 10-50 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（2010 年 2 月 3 日）基金份额总额	1,937,798,339.14
本报告期期初基金份额总额	377,591,622.00
本报告期基金总申购份额	16,669,563.32
减：本报告期基金总赎回份额	136,137,965.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	258,123,219.59

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金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。

本报告期内基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金未有基金投资策略的改变。

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有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

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

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	
渤海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	335,955,676.65	17.02%	312,875.46	19.40%	-
恒泰证券	2	330,953,875.01	16.76%	242,026.66	15.01%	-
国信证券	1	256,219,876.74	12.98%	238,616.73	14.79%	-
安信证券	1	248,573,301.82	12.59%	181,782.08	11.27%	-
方正证券	1	210,205,114.88	10.65%	153,722.60	9.53%	-
华创证券	1	204,392,818.71	10.35%	149,472.61	9.27%	-
银河证券	1	181,561,265.90	9.20%	169,088.31	10.48%	-
广发证券	1	72,472,683.57	3.67%	52,999.09	3.29%	-
东北证券	1	45,282,783.41	2.29%	33,114.51	2.05%	-
中投证券	1	39,862,576.95	2.02%	37,124.00	2.30%	-
申银万国	1	32,118,985.97	1.63%	29,912.06	1.85%	-
中信建投证券	1	16,538,807.64	0.84%	12,094.97	0.75%	-

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16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、中央交易室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
渤海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	-	-	-	-
--------	---	---	---	---	---	---

注：本报告期本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	2016-01-09
7	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
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	2016-01-14
9	新华钻石品质企业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、公司网站	2016-01-22
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	2016-01-29
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	2016-02-17
12	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
13	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、	2016-02-19

		公司网站	
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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	新华钻石品质企业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、公司网站	2016-04-21
25	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
26	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
27	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
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	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、	2016-06-06

	活动的公告	公司网站	
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
31	新华基金管理股份有限公司新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016-06-18
32	新华基金管理股份有限公司新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016-06-29

11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末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钻石品质企业股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华钻石品质企业股票型证券投资基金之法律意见书
- (三) 《新华钻石品质企业股票型证券投资基金托管协议》
- (四) 《新华钻石品质企业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《新华钻石品质企业混合型证券投资基金招募说明书》
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (九) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (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