

新华优选消费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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	错误!未定义书签。
2.2 基金产品说明.....	错误!未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人.....	错误!未定义书签。
2.4 信息披露方式.....	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	错误!未定义书签。
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	错误!未定义书签。
3.2 基金净值表现.....	错误!未定义书签。
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	错误!未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	错误!未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	错误!未定义书签。
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	错误!未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	错误!未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	错误!未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	错误!未定义书签。
5 托管人报告	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。
6 半年度财务会计报告（未经审计）	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。
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	错误!未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	错误!未定义书签。
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.5 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	错误!未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	错误!未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	错误!未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.13 投资组合报告附注.....	错误!未定义书签。
8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	错误!未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	错误!未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	错误!未定义书签。
9 开放式基金份额变动.....	43
10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	错误!未定义书签。
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变.....	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	错误!未定义书签。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	错误!未定义书签。
10.8 其他重大事件.....	错误!未定义书签。
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
12 备查文件目录.....	48
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	新华优选消费混合型证券投资基金
基金简称	新华优选消费混合
基金主代码	519150
交易代码	519150
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月13日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	359,683,965.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	精选消费行业中具有持续成长潜力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	本基金主要从定性分析和定量分析两个方面进行消费个股的精选。
业绩比较基准	80%×中证内地消费主题指数收益率 +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	-18,598,891.73
本期利润	-152,941,313.93
加权平均基金份额本期利润	-0.3306
本期加权平均净值利润率	-18.30%
本期基金份额净值增长率	-14.93%
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	322,666,571.79
期末可供分配基金份额利润	0.8971
期末基金资产净值	682,350,537.01
期末基金份额净值	1.897
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	154.08%

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	3.77%	1.01%	1.49%	1.01%	2.28%	0.00%
过去三个月	2.32%	1.28%	1.40%	0.93%	0.92%	0.35%
过去六个月	-14.93%	2.15%	-7.75%	1.52%	-7.18%	0.63%
过去一年	-19.07%	2.43%	-17.14%	1.85%	-1.93%	0.58%
过去三年	108.94%	1.80%	41.07%	1.46%	67.87%	0.34%
自基金合同生效起至今	154.08%	1.59%	28.73%	1.35%	125.35%	0.24%

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： $80\% \times \text{中证内地消费主题指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

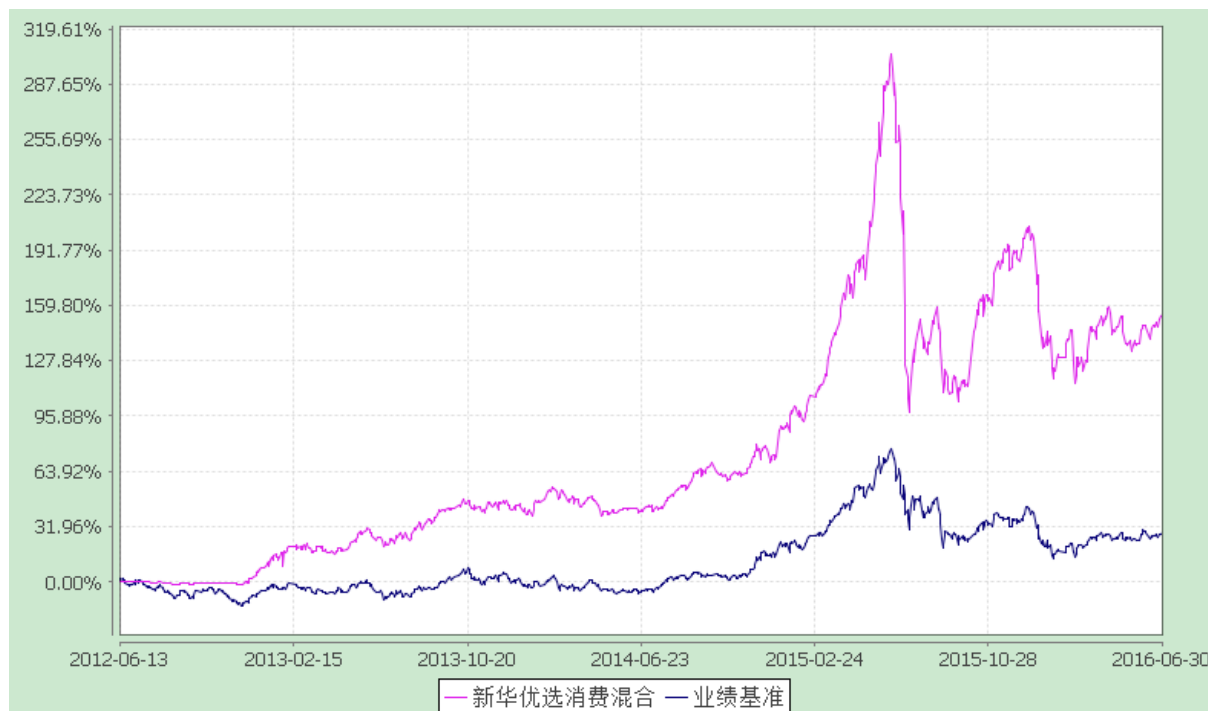
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华优选消费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

(2012年6月13日至2016年6月30日)



注：本基金于 2012 年 6 月 13 日基金合同生效；

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、新华趋势	2012-06-13	-	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

	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。				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。
张霖	本基金基金经理助理，新华基金管理股份有限公司研究部总监。	2015-09-09	2016-06-30	8	金融学硕士，8 年证券从业经验。2014 年 4 月加入新华基金管理股份有限公司。历任长城证券有限责任公司研究所所长助理、新华优选消费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研究部总监、新华优选消费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优选消费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》、《新华优选消费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所对手询价、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 1.897 元，本报告期份额净值增长率为-14.93%，同期比较基准的增长率为-7.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为经济基本面将短期企稳，而资金面宽裕和低利率环境不变，但金融监管环境明显趋严。展望下半年，我们认为市场将以震荡格局为主，将优选底部区域且估值低、符合转型和改革大方向的股票进行配置。看好 2 大方向：

1、新材料、新能源、新技术：我们认为未来政策扶持方向及财政政策会继续支持智能驾驶技术、新能源、半导体等领域。□这些领域投资由于具有产业链较长、流动性释放精准的特点，未来有望成为中央政府精准释放流动性、保证 GDP 增速的一个重要抓手；政府对新能源汽车支持力度空前，政策体系基本形成，在扶持新能源汽车发展的政策中，最受人关注的是财政补贴政策；出于对技术门槛考虑，集成电路国产化势必沿封测-制造-材料路线传导，作为集成电路制造和封测的上游，半导体材料将步入国产化替代正轨，享受集成电路行业的盛宴。

2、供给侧改革：2016 年以来，随着供给侧改革及环保压力，商品价格有所反弹且三季度有望会持续。受益于靠供给改善而非需求的扩张，高附加值工业品的涨价则与行业寡头协同调价有关。部分商品涨价趋势依然能够继续，密切关注涨价产品的相应生产企业及涨价联动收益企业

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

本基金本报告期内未对基金利润进行分配。

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优选消费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，新华优选消费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优选消费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，新华优选消费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优选消费混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，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：新华优选消费混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	146,354,458.95	176,891,912.50
结算备付金		492,707.87	2,989,895.02
存出保证金		326,632.88	435,732.39
交易性金融资产	6.4.7.2	536,042,456.21	881,528,622.84
其中：股票投资		535,694,053.32	881,528,622.84
基金投资		-	-
债券投资		348,402.89	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,181,995.04	-
应收利息	6.4.7.5	31,148.29	30,980.65
应收股利		-	-
应收申购款		34,721.09	253,434.84
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		685,464,120.33	1,062,130,578.24
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		-	20,406,539.76
应付赎回款		306,531.48	505,467.88
应付管理人报酬		928,626.50	1,310,752.51
应付托管费		154,771.09	218,458.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	1,493,864.66	2,867,809.03
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	229,789.59	461,885.01
负债合计		3,113,583.32	25,770,912.95
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.8	359,683,965.22	464,658,570.55
未分配利润	6.4.7.9	322,666,571.79	571,701,094.74
所有者权益合计		682,350,537.01	1,036,359,665.29
负债和所有者权益总计		685,464,120.33	1,062,130,578.24

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.897 元，基金份额总额 359,683,965.22 份。

6.2 利润表

会计主体：新华优选消费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		-143,480,313.98	530,707,672.46
1.利息收入		685,916.13	324,989.14
其中：存款利息收入	6.4.7.10	685,586.28	324,989.14
债券利息收入		329.85	-
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）		-10,298,164.26	253,671,856.49
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-12,937,052.71	250,272,402.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益		5,136.96	-
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	6.4.7.13	2,633,751.49	3,399,453.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-134,342,422.20	276,212,831.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	474,356.35	497,994.94
减：二、费用		9,460,999.95	12,233,281.65
1. 管理人报酬		6,258,870.13	7,823,822.03
2. 托管费		1,043,144.94	1,303,970.36

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.16	1,923,113.07	2,874,636.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.17	235,871.81	230,852.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-152,941,313.93	518,474,390.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-152,941,313.93	518,474,390.81

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华优选消费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）	464,658,570.55	571,701,094.74	1,036,359,665.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-152,941,313.93	-152,941,313.93
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）	-104,974,605.33	-96,093,209.02	-201,067,814.35
其中：1.基金申购款	229,998,001.76	175,053,898.12	405,051,899.88
2.基金赎回款	-334,972,607.09	-271,147,107.14	-606,119,714.23
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）	359,683,965.22	322,666,571.79	682,350,537.01
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）	529,755,900.01	193,422,267.32	723,178,167.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	518,474,390.81	518,474,390.81
三、本期基金份额交易产	18,624,064.96	25,294,811.47	43,918,876.43

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	220,463,604.55	253,509,133.56	473,972,738.11
2.基金赎回款	-201,839,539.59	-228,214,322.09	-430,053,861.68
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）	548,379,964.97	737,191,469.60	1,285,571,434.57

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

新华优选消费混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1948 号文核准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2012 年 5 月 11 日至 2012 年 6 月 8 日向社会公开募集,设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计 669,094,104.71 份,有效认购户数为 3,538 户,并经国富浩华会计师事务所有限公司浩华验字[2012]404A66 号验资报告予以验证。2012 年 6 月 13 日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,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《新华优选消费混合型证券投资基金招募说明书》及《新华优选消费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。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60—95%,其中投资于消费行业股票的比例不低于基金股票资产的 80%,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%。如法律法规或中国证监会变更对权证、资产支持证券等投资的比例限制,基金管理人可在履行适当程序后调整本基金的投资比例上限规定;如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华优选消费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相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期末未发生差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税字[2005]107 号文《关于

利息红利个人所得税政策的补充通知》、自 2008 年 4 月 24 日起执行的《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	146,354,458.95
定期存款	-
其他存款	-
合计	146,354,458.95

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	537,905,425.96	535,694,053.32	-2,211,372.64
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	240,200.00	348,402.89	108,202.89
	银行间市场	-	-	-
	合计	240,200.00	348,402.89	108,202.89
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		538,145,625.96	536,042,456.21	-2,103,169.75

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，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

本基金本报告期末持有买入返售金融资产。

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	30,497.95
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	331.83
应收债券利息	318.51
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	31,148.29

注：应收结算备付金利息中包含结算保证金利息。

6.4.7.6 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	1,493,864.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,493,864.66

6.4.7.7 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	1,048.35
其他应付款	-
预提费用	228,741.24
合计	229,789.59

6.4.7.8 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	464,658,570.55	464,658,570.55
本期申购	229,998,001.76	229,998,001.76
本期赎回（以“-”号填列）	-334,972,607.09	-334,972,607.09
本期末	359,683,965.22	359,683,965.22

6.4.7.9 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	519,782,028.46	51,919,066.28	571,701,094.74
本期利润	-18,598,891.73	-134,342,422.20	-152,941,313.93
本期基金份额交易产生的变动数	-110,861,066.98	14,767,857.96	-96,093,209.02
其中：基金申购款	254,077,216.49	-79,023,318.37	175,053,898.12
基金赎回款	-364,938,283.47	93,791,176.33	-271,147,107.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	390,322,069.75	-67,655,497.96	322,666,571.79

6.4.7.10 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	672,562.70
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	13,023.58

其他	-
合计	685,586.28

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息收入。

6.4.7.11 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	728,902,586.64
减：卖出股票成本总额	741,839,639.35
买卖股票差价收入	-12,937,052.71

6.4.7.12 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	20,148.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,000.00
减：应收利息总额	11.34
买卖债券差价收入	5,136.96

6.4.7.13 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	2,633,751.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,633,751.49

6.4.7.14 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	-134,342,422.20
——股票投资	-134,450,625.09
——债券投资	108,202.89
——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	-134,342,422.20

6.4.7.15 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	441,734.44
转换费收入	32,621.91
合计	474,356.35

6.4.7.16 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	1,923,113.07
银行间市场交易费用	-
合计	1,923,113.07

6.4.7.17 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	2,630.57
其他	-
合计	235,871.81

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重大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	72,723,941.58	5.79%	3,047,050.17	0.15%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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	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	53,182.76	4.91%	375,625.86	25.14%
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	2,164.56	0.13%	26,259.02	0.69%

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	6,258,870.13	7,823,822.03
其中：支付销售机构的客户维护费	383,252.89	257,461.50

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、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	1,043,144.94	1,303,970.36

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自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自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	146,354,458.95	672,562.70	145,581,027.40	300,556.91

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

本报告期本基金未进行利润分配。

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	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	网下中签	12.98	12.98	6,750.00	87,615.00	87,615.00	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下中签	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-

注：报告期末本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-----	----------	--------	--------	----

						盘单 价					
600759	洲际油气	2016-06-27	重大资产重组	7.58	2016-07-11	8.08	280,557.00	2,383,179.73	2,126,622.06	-	
000004	国农科技	2016-03-24	重大资产重组	36.83	-	-	154,000.00	4,547,016.68	5,671,820.00	-	
300038	梅泰诺	2015-12-16	重大资产重组	50.58	-	-	5,000.00	234,028.75	252,900.00	-	
300166	东方国信	2016-06-08	重大资产重组	27.47	-	-	30,000.00	737,188.80	824,100.00	-	
600455	博通股份	2016-05-05	重大资产重组	49.14	-	-	105,680.00	2,623,642.35	5,193,115.20	-	
000524	岭南控股	2016-04-04	重大资产重组	13.08	-	-	464,796.00	8,062,388.91	6,079,531.68	-	
002101	广东鸿图	2016-05-02	重大资产重组	21.62	-	-	125,000.00	3,039,069.00	2,702,500.00	-	
002231	皖通科技	2016-04-18	重大资产重组	16.54	2016-07-11	15.31	190,016.00	2,787,005.48	3,142,864.64	-	
002686	亿利达	2016-04-20	重大事项停牌	13.54	2016-07-14	14.89	150,000.00	2,097,920.32	2,031,000.00	-	
300450	先导智能	2016-03-14	重大事项停牌	37.81	2016-07-20	41.59	1,500.00	44,979.38	56,715.00	-	
000920	南方汇通	2016-02-17	重大资产重组	17.80	2016-07-12	18.10	10,000.00	198,999.86	178,000.00	-	
000955	欣龙控股	2016-04-08	重大资产重组	8.55	2016-08-10	9.00	200,000.00	1,626,980.37	1,710,000.00	-	
002289	*ST 宇顺	2016-04-29	重大事项停牌	26.04	-	-	50,000.00	1,282,167.00	1,302,000.00	-	
000975	银泰资源	2016-04-19	重大事项停牌	15.00	-	-	10,000.00	145,682.00	150,000.00	-	
300142	沃森生物	2016-03-22	重大事项停牌	11.16	-	-	600,000.00	4,924,588.80	6,696,000.00	-	
300345	红宇新材	2016-06-21	重大事项停牌	10.46	2016-07-19	11.46	148,500.00	1,567,086.41	1,553,310.00	-	
600539	*ST 狮头	2016-01-18	重大事项停牌	10.68	2016-07-26	11.21	37,924.00	473,313.88	405,028.32	-	
000639	西王食品	2016-05-27	重大资产重组	14.12	-	-	94,000.00	1,242,786.91	1,327,280.00	-	
300503	昊志机电	2016-06-30	重大事项停牌	84.72	2016-07-05	82.99	1,600.00	80,193.57	135,552.00	-	
002072	凯瑞德	2016-02-24	重大事项停牌	22.64	2016-08-17	20.38	38,000.00	667,378.40	860,320.00	-	
002492	恒基达鑫	2016-02-24	重大资产重组	12.66	-	-	200,000.00	1,825,773.92	2,532,000.00	-	

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	240,200.00	-
未评级	0.00	-
合计	240,200.00	-

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。

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	146,354,458.95	-	-	-	146,354,458.95
结算备付金	492,707.87	-	-	-	492,707.87
存出保证金	326,632.88	-	-	-	326,632.88
交易性金融资产	348,402.89	-	-	535,694,053.32	536,042,456.21
应收证券清算款	-	-	-	2,181,995.04	2,181,995.04

应收利息	-	-	-	31,148.29	31,148.29
应收申购款	-	-	-	34,721.09	34,721.09
资产总计	147,522,202.59	-	-	537,941,917.74	685,464,120.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	306,531.48	306,531.48
应付管理人报酬	-	-	-	928,626.50	928,626.50
应付托管费	-	-	-	154,771.09	154,771.09
应付交易费用	-	-	-	1,493,864.66	1,493,864.66
其他负债	-	-	-	229,789.59	229,789.59
负债总计	-	-	-	3,113,583.32	3,113,583.32
利率敏感度缺口	147,522,202.59	-	-	534,828,334.42	682,350,537.01
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	176,891,912.50	-	-	-	176,891,912.50
结算备付金	2,989,895.02	-	-	-	2,989,895.02
存出保证金	435,732.39	-	-	-	435,732.39
交易性金融资产	-	-	-	881,528,622.84	881,528,622.84
应收利息	-	-	-	30,980.65	30,980.65
应收申购款	-	-	-	253,434.84	253,434.84
资产总计	180,317,539.91	-	-	881,813,038.33	1,062,130,578.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	20,406,539.76	20,406,539.76
应付赎回款	-	-	-	505,467.88	505,467.88
应付管理人报酬	-	-	-	1,310,752.51	1,310,752.51
应付托管费	-	-	-	218,458.76	218,458.76
应付交易费用	-	-	-	2,867,809.03	2,867,809.03
其他负债	-	-	-	461,885.01	461,885.01
负债总计	-	-	-	25,770,912.95	25,770,912.95

利率敏感度缺口	180,317,539.91	-	-	856,042,125.38	1,036,359,665.29
---------	----------------	---	---	----------------	------------------

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 37		增加约 45		
	市场利率下降 25.00 bp	减少约 37		减少约 45		

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

本基金的资产与负债均以人民币计价,因此无外汇风险.

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	535,694,053.32	78.51	881,528,622.8 4	85.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	348,402.89	0.05	-	-
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	536,042,456.21	78.56	881,528,622.8 4	85.06

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%]，其中投资于消费行业股票的比例不低于基金股票资产的 80%，债券类资产的投资比例占基金资产净值比例的 [0-40%]，资产支持证券投资占基金资产资产净值的比例为[0-20%]，权证投资占基金资产净值比例[0-3%]，持有的现金和到期日在一年内的政府债券的合计比例为[在 5%以上]。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 686	增加约 1,034
	本基金业绩比较基准下降 1%	减少约 686	减少约 1,034

注：1. 本基金的整体业绩比较基准为中证内地消费主题指数收益率×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	535,694,053.32	78.15
	其中：股票	535,694,053.32	78.15
2	固定收益投资	348,402.89	0.05
	其中：债券	348,402.89	0.05
	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	146,847,166.82	21.42
7	其他各项资产	2,574,497.30	0.38
8	合计	685,464,120.33	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	8,044,410.70	1.18
B	采矿业	8,444,298.06	1.24
C	制造业	341,971,660.78	50.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,259,786.00	3.41
E	建筑业	2,342,916.48	0.34
F	批发和零售业	19,402,340.58	2.84
G	交通运输、仓储和邮政业	6,763,607.00	0.99
H	住宿和餐饮业	6,079,531.68	0.89
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,738,783.46	5.97

J	金融业	22,448,428.00	3.29
K	房地产业	37,084,901.30	5.43
L	租赁和商务服务业	4,129,765.98	0.61
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,804,160.00	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	5,858,722.00	0.86
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	7,300,615.20	1.07
	合计	535,694,053.32	78.51

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	600519	贵州茅台	90,000	26,272,800.00	3.85
2	000581	威孚高科	675,800	13,624,128.00	2.00
3	600887	伊利股份	800,000	13,336,000.00	1.95
4	300119	瑞普生物	757,699	12,161,068.95	1.78
5	000797	中国武夷	631,500	9,434,610.00	1.38
6	000423	东阿阿胶	172,712	9,124,374.96	1.34
7	002007	华兰生物	278,080	8,731,712.00	1.28
8	600422	昆药集团	602,308	8,215,481.12	1.20
9	600886	国投电力	1,239,500	8,180,700.00	1.20
10	600557	康缘药业	479,610	7,832,031.30	1.15
11	600992	贵绳股份	620,180	7,659,223.00	1.12
12	600315	上海家化	259,177	7,474,664.68	1.10
13	600313	农发种业	1,408,750	7,283,237.50	1.07
14	600007	中国国贸	357,578	7,223,075.60	1.06
15	300142	沃森生物	600,000	6,696,000.00	0.98
16	600570	恒生电子	100,000	6,677,000.00	0.98
17	002215	诺普信	609,561	6,302,860.74	0.92
18	600584	长电科技	310,000	6,289,900.00	0.92
19	002123	荣信股份	300,000	6,237,000.00	0.91
20	000524	岭南控股	464,796	6,079,531.68	0.89
21	000568	泸州老窖	200,000	5,940,000.00	0.87
22	000601	韶能股份	568,200	5,937,690.00	0.87
23	600763	通策医疗	187,900	5,858,722.00	0.86

24	600476	湘邮科技	206,368	5,817,513.92	0.85
25	600213	亚星客车	451,900	5,766,244.00	0.85
26	000004	国农科技	154,000	5,671,820.00	0.83
27	600246	万通地产	1,104,075	5,630,782.50	0.83
28	000403	ST 生化	188,000	5,562,920.00	0.82
29	600073	上海梅林	475,800	5,447,910.00	0.80
30	600455	博通股份	105,680	5,193,115.20	0.76
31	603268	松发股份	129,400	5,166,942.00	0.76
32	002185	华天科技	405,040	5,156,159.20	0.76
33	002481	双塔食品	702,000	5,124,600.00	0.75
34	600028	中国石化	1,068,300	5,042,376.00	0.74
35	600079	人福医药	299,900	5,029,323.00	0.74
36	600826	兰生股份	187,900	4,919,222.00	0.72
37	000001	平安银行	563,760	4,904,712.00	0.72
38	600050	XD 中国联	1,282,122	4,884,884.82	0.72
39	600835	上海机电	250,728	4,811,470.32	0.71
40	000822	山东海化	939,100	4,761,237.00	0.70
41	002422	科伦药业	306,096	4,716,939.36	0.69
42	300249	依米康	464,387	4,588,143.56	0.67
43	600030	中信证券	281,900	4,575,237.00	0.67
44	300382	斯莱克	120,080	4,512,606.40	0.66
45	000596	古井贡酒	94,000	4,507,300.00	0.66
46	600718	东软集团	241,000	4,415,120.00	0.65
47	600689	上海三毛	286,963	4,370,446.49	0.64
48	000785	武汉中商	389,817	4,346,459.55	0.64
49	600305	恒顺醋业	375,800	4,329,216.00	0.63
50	000590	启迪古汉	193,100	4,279,096.00	0.63
51	000539	粤电力 A	845,700	4,245,414.00	0.62
52	000848	承德露露	352,894	4,217,083.30	0.62
53	601888	中国国旅	93,901	4,129,765.98	0.61
54	002077	大港股份	182,826	4,058,737.20	0.59
55	600536	中国软件	161,400	4,022,088.00	0.59
56	600278	东方创业	250,000	3,887,500.00	0.57
57	600605	汇通能源	199,907	3,856,206.03	0.57
58	300113	顺网科技	100,083	3,799,150.68	0.56
59	601998	中信银行	657,500	3,728,025.00	0.55
60	600129	太极集团	209,304	3,706,773.84	0.54
61	002412	汉森制药	201,800	3,575,896.00	0.52
62	601211	国泰君安	200,600	3,568,674.00	0.52
63	002101	广东鸿图	162,500	3,513,250.00	0.51
64	600114	东睦股份	187,900	3,158,599.00	0.46
65	002331	皖通科技	190,016	3,142,864.64	0.46
66	300130	新国都	100,500	3,105,450.00	0.46
67	600225	天津松江	500,500	3,008,005.00	0.44

68	300088	长信科技	201,800	3,000,766.00	0.44
69	300452	山河药辅	60,200	2,932,944.00	0.43
70	601688	华泰证券	150,000	2,838,000.00	0.42
71	000523	广州浪奇	261,000	2,837,070.00	0.42
72	002557	洽洽食品	150,882	2,812,440.48	0.41
73	600236	桂冠电力	409,500	2,751,840.00	0.40
74	600594	益佰制药	165,568	2,645,776.64	0.39
75	600289	亿阳信通	187,900	2,628,721.00	0.39
76	000488	晨鸣纸业	328,300	2,606,702.00	0.38
77	601965	中国汽研	264,800	2,544,728.00	0.37
78	002492	恒基达鑫	200,000	2,532,000.00	0.37
79	000776	广发证券	150,500	2,522,380.00	0.37
80	600872	中炬高新	200,000	2,468,000.00	0.36
81	600178	东安动力	281,600	2,455,552.00	0.36
82	000599	青岛双星	350,000	2,408,000.00	0.35
83	002081	金螳螂	233,824	2,342,916.48	0.34
84	002214	大立科技	187,900	2,316,807.00	0.34
85	000089	深圳机场	268,600	2,283,100.00	0.33
86	603010	万盛股份	99,930	2,210,451.60	0.32
87	000561	烽火电子	196,700	2,187,304.00	0.32
88	000543	皖能电力	300,300	2,144,142.00	0.31
89	600759	洲际油气	280,557	2,126,622.06	0.31
90	002510	天汽模	250,000	2,080,000.00	0.30
91	300165	天瑞仪器	187,906	2,035,021.98	0.30
92	002686	亿利达	150,000	2,031,000.00	0.30
93	002216	三全食品	234,900	2,020,140.00	0.30
94	002074	国轩高科	50,000	1,973,500.00	0.29
95	300210	森远股份	109,900	1,965,012.00	0.29
96	002117	东港股份	60,700	1,909,622.00	0.28
97	300103	达刚路机	100,366	1,876,844.20	0.28
98	000910	大亚科技	120,858	1,867,256.10	0.27
99	001979	招商蛇口	129,056	1,839,048.00	0.27
100	000069	华侨城 A	281,900	1,804,160.00	0.26
101	600699	均胜电子	47,000	1,800,100.00	0.26
102	600684	珠江实业	234,900	1,764,099.00	0.26
103	600787	中储股份	234,900	1,745,307.00	0.26
104	000955	欣龙控股	200,000	1,710,000.00	0.25
105	002664	信质电机	50,000	1,701,000.00	0.25
106	000858	五粮液	50,000	1,626,500.00	0.24
107	000554	泰山石油	187,800	1,615,080.00	0.24
108	002133	广宇集团	250,000	1,610,000.00	0.24
109	600460	士兰微	200,000	1,586,000.00	0.23
110	600469	风神股份	147,750	1,572,060.00	0.23
111	600325	华发股份	141,000	1,560,870.00	0.23

112	300345	红宇新材	148,500	1,553,310.00	0.23
113	603678	火炬电子	19,163	1,460,603.86	0.21
114	300123	太阳鸟	100,000	1,404,000.00	0.21
115	600571	信雅达	25,000	1,378,000.00	0.20
116	600230	*ST 沧大	138,900	1,376,499.00	0.20
117	000639	西王食品	94,000	1,327,280.00	0.19
118	002289	*ST 宇顺	50,000	1,302,000.00	0.19
119	002078	太阳纸业	234,900	1,146,312.00	0.17
120	000034	神州数码	47,000	1,057,500.00	0.15
121	600850	华东电脑	32,500	932,425.00	0.14
122	300231	银信科技	47,000	866,680.00	0.13
123	002072	凯瑞德	38,000	860,320.00	0.13
124	300166	东方国信	30,000	824,100.00	0.12
125	000909	数源科技	40,000	821,600.00	0.12
126	600371	万向德农	46,986	761,173.20	0.11
127	000026	飞亚达 A	61,100	698,373.00	0.10
128	603508	思维列控	6,896	685,531.36	0.10
129	002341	新纶科技	30,000	645,900.00	0.09
130	600658	电子城	57,800	597,074.00	0.09
131	600549	厦门钨业	20,000	594,200.00	0.09
132	002439	启明星辰	23,000	594,090.00	0.09
133	300433	蓝思科技	21,000	590,520.00	0.09
134	000912	泸天化	94,100	559,895.00	0.08
135	300473	德尔股份	8,000	559,600.00	0.08
136	002454	松芝股份	30,000	545,400.00	0.08
137	002368	太极股份	15,000	532,950.00	0.08
138	002371	七星电子	12,000	501,840.00	0.07
139	601689	拓普集团	15,100	497,545.00	0.07
140	601958	金铂股份	60,000	489,000.00	0.07
141	300011	鼎汉技术	20,000	469,400.00	0.07
142	603936	博敏电子	10,000	468,600.00	0.07
143	600458	时代新材	30,000	467,400.00	0.07
144	002154	报喜鸟	94,000	454,020.00	0.07
145	300474	景嘉微	3,000	452,610.00	0.07
146	300034	钢研高纳	20,000	442,000.00	0.06
147	002709	天赐材料	6,250	437,125.00	0.06
148	300460	惠伦晶体	16,000	434,400.00	0.06
149	002042	华孚色纺	40,000	413,600.00	0.06
150	600539	*ST 狮头	37,924	405,028.32	0.06
151	300458	全志科技	3,710	396,895.80	0.06
152	002502	骅威文化	16,000	393,600.00	0.06
153	600855	航天长峰	12,500	391,250.00	0.06
154	600547	山东黄金	10,000	389,100.00	0.06
155	300457	赢合科技	5,000	387,050.00	0.06

156	002030	达安基因	13,772	382,861.60	0.06
157	603696	安记食品	9,000	375,300.00	0.06
158	300416	苏试试验	10,000	346,000.00	0.05
159	002450	康得新	19,986	341,760.60	0.05
160	300228	富瑞特装	20,000	340,000.00	0.05
161	300199	翰宇药业	16,000	325,600.00	0.05
162	000712	锦龙股份	15,000	311,400.00	0.05
163	603800	道森股份	10,000	307,500.00	0.05
164	002055	得润电子	10,000	306,200.00	0.04
165	600132	XD 重庆啤	20,000	303,800.00	0.04
166	601600	中国铝业	80,000	301,600.00	0.04
167	002520	日发精机	20,000	295,200.00	0.04
168	300470	日机密封	3,000	291,960.00	0.04
169	300007	汉威电子	10,000	279,200.00	0.04
170	002334	英威腾	30,000	267,000.00	0.04
171	000831	*ST 五稀	20,000	263,600.00	0.04
172	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.04
173	300160	秀强股份	20,000	257,400.00	0.04
174	300038	梅泰诺	5,000	252,900.00	0.04
175	000762	西藏矿业	10,000	247,200.00	0.04
176	600603	*ST 兴业	20,000	228,400.00	0.03
177	603005	晶方科技	6,000	227,220.00	0.03
178	300370	安控科技	20,000	227,200.00	0.03
179	002434	万里扬	20,000	217,600.00	0.03
180	601919	中国远洋	40,000	203,200.00	0.03
181	000732	泰禾集团	10,000	194,400.00	0.03
182	002667	鞍重股份	6,000	182,940.00	0.03
183	000920	南方汇通	10,000	178,000.00	0.03
184	000036	华联控股	20,000	164,200.00	0.02
185	600429	三元股份	20,000	156,600.00	0.02
186	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.02
187	300150	世纪瑞尔	14,100	152,703.00	0.02
188	000975	银泰资源	10,000	150,000.00	0.02
189	300503	昊志机电	1,600	135,552.00	0.02
190	002570	贝因美	10,000	127,900.00	0.02
191	300420	五洋科技	2,000	125,680.00	0.02
192	002048	宁波华翔	5,000	114,350.00	0.02
193	002599	盛通股份	3,000	107,460.00	0.02
194	603009	北特科技	2,500	106,350.00	0.02
195	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.01
196	300121	阳谷华泰	6,500	88,985.00	0.01
197	601966	玲珑轮胎	6,750	87,615.00	0.01
198	002780	三夫户外	1,000	79,500.00	0.01
199	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01

200	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01
201	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
202	300450	先导智能	1,500	56,715.00	0.01
203	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
204	000969	安泰科技	3,100	43,493.00	0.01
205	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
206	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
207	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
208	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
209	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
210	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	600519	贵州茅台	24,185,914.50	2.33
2	000797	中国武夷	17,999,849.88	1.74
3	600887	伊利股份	12,744,597.80	1.23
4	300119	瑞普生物	12,245,707.90	1.18
5	600129	太极集团	11,412,855.87	1.10
6	000001	平安银行	11,228,819.60	1.08
7	600036	招商银行	10,176,380.37	0.98
8	000776	广发证券	10,160,034.88	0.98
9	002007	华兰生物	8,160,987.40	0.79
10	000423	东阿阿胶	7,907,552.79	0.76
11	600030	中信证券	7,500,000.00	0.72
12	000581	威孚高科	7,421,560.89	0.72
13	600028	中国石化	7,421,360.00	0.72
14	600763	通策医疗	7,027,129.95	0.68
15	600557	康缘药业	6,903,231.90	0.67
16	600570	恒生电子	6,690,000.00	0.65
17	601688	华泰证券	6,633,000.00	0.64
18	002510	天汽模	6,444,460.94	0.62
19	000403	ST 生化	6,412,927.51	0.62
20	002123	荣信股份	6,292,828.00	0.61

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	601688	华泰证券	19,585,008.74	1.89
2	601009	南京银行	18,140,462.18	1.75
3	601211	国泰君安	17,264,433.37	1.67
4	600129	太极集团	16,144,881.11	1.56
5	000001	平安银行	15,919,519.00	1.54
6	002599	盛通股份	15,285,879.37	1.47
7	600266	北京城建	14,914,274.00	1.44
8	000779	三毛派神	14,401,451.35	1.39
9	002142	宁波银行	13,961,136.82	1.35
10	000776	广发证券	13,886,434.00	1.34
11	600028	中国石化	13,081,040.00	1.26
12	300130	新国都	12,355,900.78	1.19
13	002112	三变科技	11,703,053.01	1.13
14	603010	万盛股份	10,762,278.00	1.04
15	601318	中国平安	10,732,318.00	1.04
16	600036	招商银行	10,594,075.00	1.02
17	600455	博通股份	10,513,250.28	1.01
18	000797	中国武夷	10,180,411.41	0.98
19	002368	太极股份	10,062,020.50	0.97
20	600883	博闻科技	9,103,864.00	0.88

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	530,455,694.92
卖出股票的收入（成交）总额	728,902,586.64

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

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）	348,402.89	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	348,402.89	0.05

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	2,402	348,402.89	0.05

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.8.1 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。

7.8.2 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。

7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

7.9.3 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本报告期末本基金投资的前十名证券没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2 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。

7.10.3 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	326,632.88
2	应收证券清算款	2,181,995.04
3	应收股利	-
4	应收利息	31,148.29
5	应收申购款	34,721.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,574,497.30

7.10.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.10.5 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	持有人结构
----------	-------	-------

	基金份额	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
4,966	72,429.31	304,523,477.26	84.66%	55,160,487.96	15.34%

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	0.00	0.00%

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（2012 年 6 月 13 日）基金份额总额	669,094,104.71
本报告期期初基金份额总额	464,658,570.55
本报告期基金总申购份额	229,998,001.76
减：本报告期基金总赎回份额	334,972,607.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	359,683,965.22

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。

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	
宏信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	278,645,473.12	22.19%	259,501.77	23.97%	-
华泰证券	1	252,226,966.49	20.09%	184,453.81	17.03%	-
国信证券	1	208,353,093.57	16.59%	194,038.51	17.92%	-
方正证券	1	107,135,850.61	8.53%	78,348.71	7.24%	-
广发证券	1	89,188,367.28	7.10%	83,061.03	7.67%	-
长江证券	1	76,580,484.19	6.10%	71,319.69	6.59%	-
国泰君安	1	73,290,419.69	5.84%	68,255.52	6.30%	-
安信证券	1	67,627,185.94	5.39%	62,981.22	5.82%	-
恒泰证券	2	72,723,941.58	5.79%	53,182.76	4.91%	-
招商证券	1	22,186,737.46	1.77%	20,662.54	1.91%	-
中信证券	1	6,997,325.00	0.56%	6,516.75	0.60%	-
西南证券	1	681,800.00	0.05%	498.61	0.05%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证

监基字[1998]29号)以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本基金报告期内共租用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
宏信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-

宏源证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	20,148.30	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

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
7	新华优选消费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
8	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-28

9	新华基金管理股份有限公司关于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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	新华优选消费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
22	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
23	新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销系统招商银行网银支付费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、	2016-04-29

		公司网站	
24	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
25	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
26	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
27	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优选消费股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华优选消费股票型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华优选消费股票型证券投资基金托管协议
- (四) 新华优选消费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《新华优选消费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