

# 新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金

## 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十七日

## 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 25 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 2014 年 4 月 16 日（基金合同生效日）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
1.2	目录 .....	3
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.....	6
2.4	信息披露方式 .....	6
2.5	其他相关资料 .....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现 .....	8
4	管理人报告 .....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5	托管人报告 .....	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
6	半年度财务会计报告（未经审计） .....	15
6.1	资产负债表 .....	15
6.2	利润表 .....	17
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4	报表附注 .....	20
7	投资组合报告 .....	42
7.1	期末基金资产组合情况.....	42
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12	投资组合报告附注.....	46
8	基金份额持有人信息.....	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
9	开放式基金份额变动.....	47
10	重大事件揭示.....	48
10.1	基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4	基金投资策略的改变.....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8	其他重大事件.....	50
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	51
12	备查文件目录.....	51
12.1	备查文件目录.....	51
12.2	存放地点.....	51
12.3	查阅方式.....	52

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新华一路财富灵活配置混合
基金主代码	000584
交易代码	000584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月16日
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	401,770,288.62份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	综合运用多种投资策略，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上，力争为投资人提供长期稳定的绝对回报。
投资策略	<p>投资策略的选择，本基金将兼顾下行风险控制和收益获取。在资产配置策略方面，主要采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。</p> <p>在股票投资策略方面，把握趋势跟随及绝对收益两个核心，趋势跟随策略以期在某行业或个股出现趋势性机会时，积极跟随其市场表现；绝对收益策略以类套利策略为目标，以期获取稳定的绝对回报。在债券投资策略方面，本基金将综合运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略、中小企业私募债券投资策略及可转换债券投资策略，在获取稳定收益的同时，降低基金资产净值整体的波动性。</p>

业绩比较基准	年化收益率10%
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		新华基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	方琦
	联系电话	010-88423386	0755-22168073
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	fangqi275@pingan.com.cn
客户服务电话		4008198866	95511
传真		010-88423310	0755-82080400
注册地址		重庆市江北区建新东路85号 附1号1层1-1	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址		重庆市渝中区较场口88号得意商厦A座7-2;北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
邮政编码		400010	518000
法定代表人		陈重	孙建一

### 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	新华基金管理有限公司	重庆市渝中区较场口88号得意商厦 A座7-2;北京市海淀区西三环北路 11号海通时代商务中心C1座

## 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（2014年4月16日（基金合同生效日）至2014年6月30日）
本期已实现收益	63,312.74
本期利润	-225,385.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0009
本期加权平均净值利润率	-0.09%
本期基金份额净值增长率	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	140,510.27
期末可供分配基金份额利润	0.0003
期末基金资产净值	401,926,755.93
期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.00%

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）。

4、本基金于 2014 年 4 月 16 日成立。

### 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 1 月	-0.40%	0.09%	0.82%	0.00%	-1.22%	0.09%
自基金成立至今	0.00%	0.08%	2.08%	0.00%	-2.08%	0.08%

注：1、本基金业绩比较基准采用年化收益率 10%

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、本基金于 2014 年 4 月 16 日成立，成立不满一年。

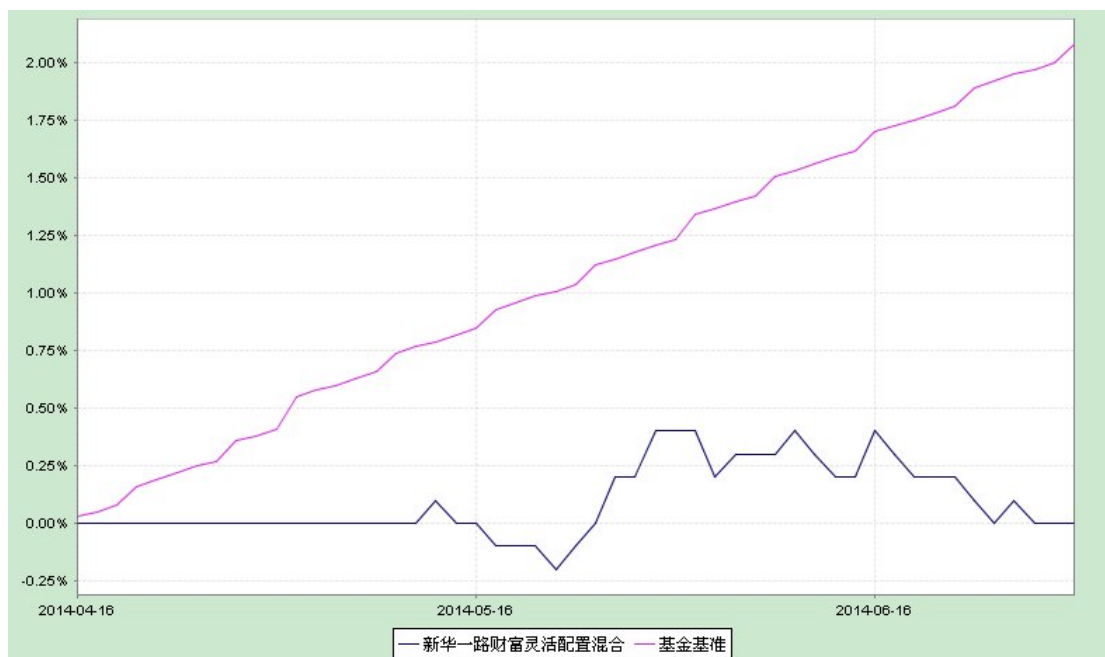
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金

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 16 日至 2014 年 6 月 30 日）





注：1、本基金建仓期为 6 个月，本报告期，本基金处于建仓期。

2、本基金于 2014 年 4 月 16 日成立，成立不满一年。

## 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 2014 年 6 月 30 日，新华基金管理有限公司旗下管理着十九只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业股票型证券投资基金、新华行业周期轮换股票型证券投资基金、新华中小市值优选股票型证券投资基金、新华灵活主题股票型证券投资基金、新华优选消费股票型证券投资基金、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、新华趋势领航股票型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华信用增益债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华惠鑫分级债券型证券投资基金、新华一路财富灵活配置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、新华阿里一号保本混合型证券投资基金和新华鑫安保本一号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	本基金基金经理助理、金融工程部副总监、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理助理。	2014-04-16	-	7	经济学硕士，7 年证券从业经验。2007 年 9 月加入新华基金管理有限公司，历任新华基金管理有限公司行业研究员、策略分析师、新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理助理。现任新华基金管理有限公司金融工程部副总监、新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理助理。
贲兴振	本基金基金经理、新华壹诺宝货币市场基金基	2014-04-16	-	7	经济学硕士，7 年证券从业经验。历任北京市系统工程研究中心研究员。贲兴振先生于

	金经理、新华中小市值优选股票型证券投资基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理。			2007 年 9 月加入新华基金管理有限公司，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。现任新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华中小市值优选股票型证券投资基金基金经理、新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫安保本一号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，新华基金管理有限公司作为新华一路财富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》、《新华一路财富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，投资指令统一由中央交易室下达，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，中央交易室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，由中央交易室报投资总监、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，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中央交易室下达投资指令，中央交易室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段时间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说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

上半年政府逐步出台了一系列的微刺激政策，主板市场整体平稳，创业板大幅波动。蓝筹股整体表现继续平稳，二季度波动幅度较一季度进一步收窄，创业板的大幅波动则经历了快速上涨、快速下跌和快速反弹三个过程。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.000 元，本报告期份额净值增长率为 0.00%，

同期比较基准的增长率为 2.08%。

#### 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，新股将会继续发行，目前创业板估值仍在历史高点，存在着比较大的风险，在投资策略上，我们将继续秉持价值投资理念，布局未来业绩有稳定增长、短期股价调整较多的绩优蓝筹带来的中长期投资机会；以及继续坚持自下而上挖掘优质成长个股的策略，力争为投资者取得较好收益。

#### 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、中央交易室、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、中央交易室的职责分工

- 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。

## 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，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本报告期内，由新华基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

平安银行股份有限公司资产托管部  
2014年8月25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：新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日
<b>资 产:</b>		
银行存款	6.4.7.1	19,535,317.33
结算备付金		16,413,150.09
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	21,927,531.10
其中：股票投资		21,927,531.10
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	6.4.7.3	345,000,000.00
应收证券清算款		245,174.99
应收利息	6.4.7.4	24,873.77
应收股利		-
应收申购款		1,001.00
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		403,147,048.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		421,141.15
应付管理人报酬		371,418.13
应付托管费		61,903.04
应付销售服务费		247,612.09
应付交易费用	6.4.7.5	15,710.66
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	102,507.28
负债合计		1,220,292.35
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.7	401,770,288.62
未分配利润	6.4.7.8	156,467.31
所有者权益合计		401,926,755.93
负债和所有者权益总计		403,147,048.28

注：1、本基金自 2014 年 4 月 16 日成立，至 2014 年 6 月 30 日披露日未满一年。

2、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 401,770,288.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2014 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日

<b>一、收入</b>		<b>1,293,088.72</b>
1.利息收入		1,299,049.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	146,032.48
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		1,153,017.16
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		282,672.06
其中：股票投资收益		-
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	6.4.7.10	282,672.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	-288,698.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	65.37
<b>减：二、费用</b>		<b>1,518,474.33</b>
1. 管理人报酬		761,878.11
2. 托管费		126,979.68
3. 销售服务费		507,918.73
4. 交易费用	6.4.7.13	18,290.53
5. 利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.14	103,407.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-225,385.61</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-225,385.61</b>

注：本基金于 2014 年 4 月 16 日成立，无可比期间对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2014 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2014 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）	211,129,655.08	-	211,129,655.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-225,385.61	-225,385.61
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）	190,640,633.54	381,852.92	191,022,486.46
其中：1. 基金申购款	195,613,026.62	391,104.33	196,004,130.95
2. 基金赎回款	-4,972,393.08	-9,251.41	-4,981,644.49
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）	401,770,288.62	156,467.31	401,926,755.93

注：本基金于 2014 年 4 月 16 日成立，无可比期间对比数据。

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

新华一路财富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]243号文件“关于核准新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金募集的批复”,由新华基金管理有限公司作为发起人,于2014年3月14日至4月14日向社会公开募集,首次募集资金总额211,129,655.08元,其中募集净认购资金金额211,107,809.39元,募集资金产生利息21,845.69元,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2014]第37100014号验资报告予以验证。2014年4月16日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不设定,本基金管理人为新华基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票投资占基金资产的比例范围为0—95%,单只中小企业私募债券市值不超过基金资产的10%,权证投资占基金资产净值的比例范围为0—3%,现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理有限公司于2014年8月27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》、《新华一路财富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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融资产和金融负债的初始确认和终止确认（证券投资基金成本计价方法）

### 1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

#### a 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### b 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于交易日按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按 6.4.4.4(1)、1)、c 所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

#### c 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资，权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

### 2) 贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

### 3) 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确

认金额。

#### (2) 金融资产和金融负债的后续计量

本基金持有的金融资产和金融负债的后续计量与其分类相关联。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，按照公允价值后续计量，公允价值变动计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，采用实际利率法，按摊余成本计量。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

##### 1) 估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3) 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

#### (2) 主要资产的估值方法

##### 1) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

## 2) 债券投资

交易所上市实行净价交易的债券按估值日证券交易所上市的收盘价为公允价值。交易所上市但未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息后的净价为公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日收盘价确定公允价值。估值日无交易但最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

全国银行间同业市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种采用估值技术确定公允价值。同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别确定公允价值。

## 3) 权证投资

因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值；在估值技术难以



可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

4) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期

内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的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。

本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、本基金每份基金份额享有同等分配权；

2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

5、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期内未有其他重要的会计政策和会计估计。

#### **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
	2014 年 6 月 30 日
活期存款	19,535,317.33
定期存款	-
存款期限 1 月以内	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	19,535,317.33

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,216,229.45	21,927,531.10	-288,698.35
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	22,216,229.45	21,927,531.10	-288,698.35

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

## 6.4.7.3 买入返售金融资产

## 6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所	345,000,000.00	-
合计	345,000,000.00	-

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

## 6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	18,226.37
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	6,647.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	24,873.77

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

## 6.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	15,710.66

银行间市场应付交易费用	-
合计	15,710.66

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	102,507.28
合计	102,507.28

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	211,129,655.08	211,129,655.08
本期申购	195,613,026.62	195,613,026.62
本期赎回（以“-”号填列）	-4,972,393.08	-4,972,393.08
本期末	401,770,288.62	401,770,288.62

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.8 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

基金合同生效日	-	-	-
本期利润	63,312.74	-288,698.35	-225,385.61
本期基金份额交易产生的变动数	77,197.53	304,655.39	381,852.92
其中：基金申购款	76,941.11	314,163.22	391,104.33
基金赎回款	256.42	-9,507.83	-9,251.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	140,510.27	15,957.04	156,467.31

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	116,134.70
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	29,897.78
其他	-
合计	146,032.48

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	282,672.06

基金投资产生的股利收益	-
合计	282,672.06

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年4月16日（基金合同生效日）至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-288,698.35
——股票投资	-288,698.35
——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	-288,698.35

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年4月16日（基金合同生效日）至2014年6月30日
基金赎回费收入	65.37
合计	65.37

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。



**6.4.7.13 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2014年4月16日（基金合同生效日）至2014年6月30日
交易所市场交易费用	18,290.53
银行间市场交易费用	-
合计	18,290.53

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

**6.4.7.14 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2014年4月16日（基金合同生效日）至2014年6月30日
审计费用	23,384.44
信息披露费	79,122.84
其他	900.00
合计	103,407.28

注：本基金 2014 年 4 月 16 日成立，报告截止日 2014 年 6 月 30 日未满一年。

**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 2014 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
-------	---------

新华基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
平安银行股份有限公司	基金托管人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金自 2014 年 4 月 16 日成立，至 2014 年 6 月 30 日未满一年，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

本基金自 2014 年 4 月 16 日成立，至 2014 年 6 月 30 日未满一年，本基金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

本基金自 2014 年 4 月 16 日成立，至 2014 年 6 月 30 日未满一年，本基金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

本基金自 2014 年 4 月 16 日成立，至 2014 年 6 月 30 日未满一年，本基金无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年4月16日（基金合同生效日）至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	761,878.11

其中：支付销售机构的客户维护费	56,289.02
-----------------	-----------

注：1、本基金于 2014 年 4 月 16 日成立，可比期间无对比数据。

2、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。

3、本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014年4月16日（基金合同生效日）至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	126,979.68

注：1、本基金于 2014 年 4 月 16 日成立，可比期间无对比数据。

2、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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2014年4月16日（基金合同生效日）至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
新华基金管理有限公司	414,104.93
合计	414,104.93

注：本基金销售服务费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

本基金自 2014 年 4 月 16 日成立，至 2014 年 6 月 30 日未满一年。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本报告期末与关联方进行银行债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

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

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年4月16日（基金合同生效日）至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国平安银行	19,535,317.33	116,134.70

注：本基金于 2014 年 4 月 16 日成立，可比期间无对比数据。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期间无收益分配事项。

**6.4.12 期末（2014 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	证券	成功	可流	流通	认购	期末估	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	通日	受限 类型	价格	值单价	(单 位: 股)	成本总额	估值总额	
002727	一心 堂	2014-06- 25	2014-07- 02		12.20	12.20	2,331	28,438.20	28,438.20	-
603168	莎普 爱思	2014-06- 24	2014-07- 02		21.85	21.85	3,331	72,782.35	72,782.35	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

#### 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，并按照合同约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 2014年6 月30日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月-1 年	1年以 内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产										

银行存款	-	-	-	-	-	19,535,317.33	-	-	-	19,535,317.33
结算备付金	-	-	-	-	-	16,413,150.09	-	-	-	16,413,150.09
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	21,927,531.10	21,927,531.10	21,927,531.10
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	345,000,000.00	-	-	-	345,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	245,174.99	245,174.99	245,174.99
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	24,873.77	24,873.77	24,873.77
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	1,001.00	1,001.00	1,001.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-	-	380,948,467.42	-	22,198,580.86	403,147,048.28	403,147,048.28
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	421,141.15	421,141.15	421,141.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	371,418.13	371,418.13	371,418.13
应付托管	-	-	-	-	-	-	-	61,903.0	61,903.0	61,903.0

费									4	4
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	15,710.66	15,710.66
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	102,507.28	102,507.28
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	972,680.26	972,680.26
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	380,948,467.42	-	-	21,225,900.60	402,174,368.02

#### 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）
		本期末 2014年6月30日
	市场利率上升25.00 bp	952,371.17
	市场利率下降25.00 bp	-952,371.17

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

本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

##### 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 2014年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	21,927,531.10	5.46
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	21,927,531.10	5.46

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%。于 2014 年 6 月 30 日，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)
		本期末 2014年6月30日
	本基金业绩比较基准上升 1%	134,229.32
	本基金业绩比较基准下降 1%	-134,229.32

注：1. 本基金的整体业绩比较基准为年化收益率 10%；

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	21,927,531.10	5.44
	其中：股票	21,927,531.10	5.44
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	345,000,000.00	85.58
	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	35,948,467.42	8.92
7	其他各项资产	271,049.76	0.07
8	合计	403,147,048.28	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	5,667,310.50	1.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	28,438.20	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	5,501,600.00	1.37
K	房地产业	10,730,182.40	2.67
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,927,531.10	5.46

### 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	600759	正和股份	1,049,920	10,730,182.40	2.67

2	000651	格力电器	189,967	5,594,528.15	1.39
3	002142	宁波银行	598,000	5,501,600.00	1.37
4	603168	莎普爱思	3,331	72,782.35	0.02
5	002727	一心堂	2,331	28,438.20	0.01

#### 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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600759	正和股份	10,991,682.75	2.73
2	000651	格力电器	5,625,296.52	1.40
3	002142	宁波银行	5,498,029.63	1.37
4	603168	莎普爱思	72,782.35	0.02
5	002727	一心堂	28,438.20	0.01

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

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金于 2014 年 4 月 16 日成立至 2014 年 6 月 30 日，未卖出股票。

##### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	22,216,229.45
卖出股票的收入（成交）总额	-

注：1、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。

2、本基金于 2014 年 4 月 16 日成立至 2014 年 6 月 30 日，未卖出股票。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无股指期货投资。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金无股指期货投资。

#### 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 本基金投资国债期货的投资政策

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

**7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价**

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** 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2** 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	-
2	应收证券清算款	245,174.99
3	应收股利	-
4	应收利息	24,873.77
5	应收申购款	1,001.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	271,049.76

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的	占基金资	流通受限情况说明
----	------	------	---------	------	----------

			公允价值	产净值比 例 (%)	
1	002727	一心堂	28,438.20	0.01	新股未上市流通
2	603168	莎普爱思	72,782.35	0.02	新股未上市流通

### 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
2,071	193,998.21	357,452,774.45	88.97%	44,317,514.17	11.03%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年4月16日）基金份额总额	211,129,655.08
---------------------------	----------------

本报告期基金总申购份额	195,613,026.62
减：本报告期基金总赎回份额	4,972,393.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	401,770,288.62

## 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

2014 年 6 月 11 日，晏益民先生担任新华基金管理有限公司副总经理一职。

### 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 为基金进行审计的会计师事务所情况

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的情况

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	
光大证券	2	22,115,008.90	100.00%	15,710.66	100.00%	-

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，本基金报告期内新成立基金，共租用2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
光大证券	-	-	7,776,400,000.00	100.00%	-	-

### 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	新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2014-3-11
2	新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2014-3-11
3	新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2014-3-11
4	新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2014-3-11
5	新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2014-3-11
6	新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金	中国证券报、证券时	2014-4-17

	基金合同生效公告	报、上海证券报、证券日报、公司网站	
7	新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购（赎回、定期定额投资）业务公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2014-6-11
8	新华基金管理有限公司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	2014-6-25

## 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一路财富灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (五) 《新华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (六) 《新华一路财富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) 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。

新华基金管理有限公司  
二〇一四年八月二十七日