

新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金
2015 年半年度报告
2015 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：二〇一五年八月二十六日

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 2015 年 8 月 24 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 2015 年 4 月 10 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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
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.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
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.....	42

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	43
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	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	45
11 影响投资者决策的其他重要信息	46
12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新华万银多元策略灵活配置混合
基金主代码	000972
交易代码	000972
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 10 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	261,742,877.80 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	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。在股票投资策略方面，把握主题投资、趋势跟随及绝对收益三个核心，主题投资策略以选择主题类板块为主要投资标的进行投资；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。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×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	张波
	联系电话	010-88423386	0755-22168073
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	Zhangbo746@pingan.com.cn

客户服务电话	4008198866	95511-3
传真	010-88423310	0755-82080386
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号
邮政编码	400010	518001
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

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（2015年4月10日（基金合同生效日）至 2015年6月30日）
本期已实现收益	56,879,833.88
本期利润	31,927,186.14
加权平均基金份额本期利润	0.1052
本期加权平均净值利润率	9.20%
本期基金份额净值增长率	11.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	28,825,449.76
期末可供分配基金份额利润	0.11
期末基金资产净值	290,568,327.56
期末基金份额净值	1.110
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	11.00%

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	-8.42%	3.29%	-4.16%	2.10%	-4.26%	1.19%
过去三个月	11.00%	2.44%	2.65%	1.64%	8.35%	0.80%
过去六个月	11.00%	2.44%	2.65%	1.64%	8.35%	0.80%
自基金合同生效起至今	11.00%	2.44%	2.65%	1.64%	8.35%	0.80%

注：1、本基金于 2015 年 4 月 10 日基金合同生效；

2、本基金业绩比较基准为：60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率；

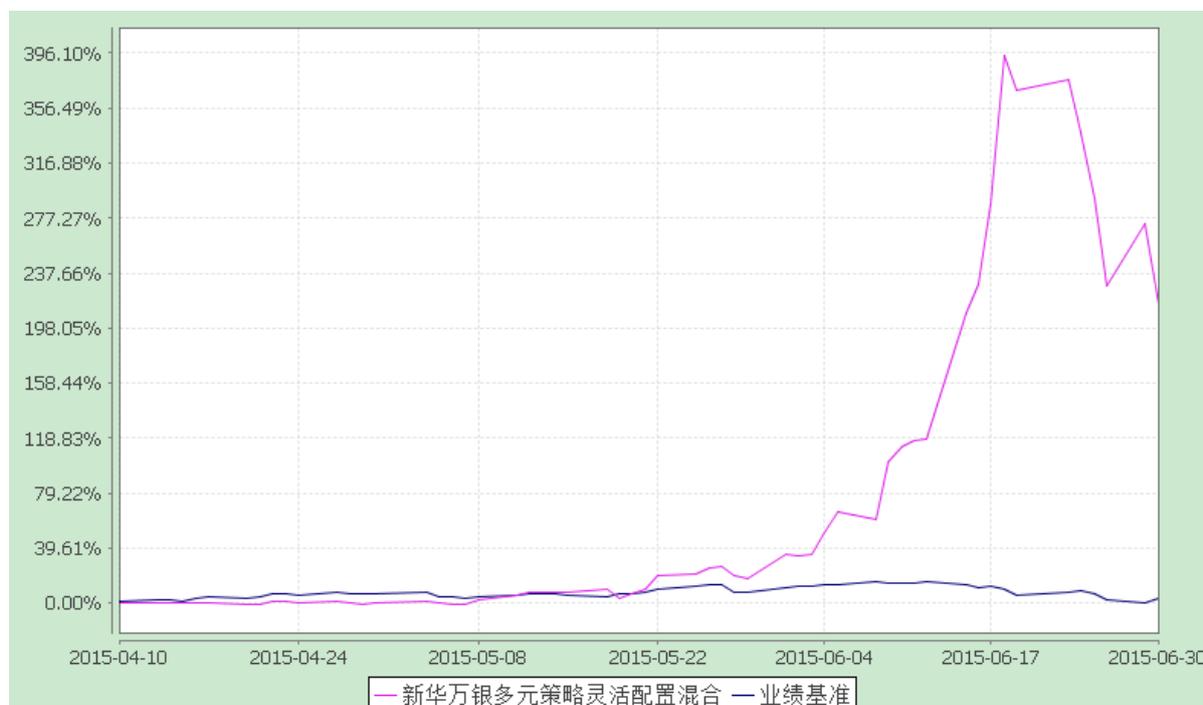
3、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 4 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日)



注：1、本基金于 2015 年 4 月 10 日基金合同生效；

2、本基金建仓期为 6 个月，本报告期，本基金处于建仓期。

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 2015 年 6 月 30 日，新华基金管理有限公司旗下管理着 28 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、新华鑫益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、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、新华财富金 30 天理财债券型证券投资基金、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。

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		
贲兴振	本基金基金经理、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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理	2015-04-10	-	8	经济学硕士，8 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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理

	金经理、新华财富金 30 天理财债券型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业股票型证券投资基金基金经理。				金经理、新华财富金 30 天理财债券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、新华钻石品质企业股票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万银多元策略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》、《新华万银多元策略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

今年前五个月股票市场持续性逼空的单边行情，本基金保持高仓位，重点配置符合未来经济结构调整方向的投资标的。二季度后期，清理场外配资引发市场恐慌，市场极速大跌。本基金在二季度考虑到市场结构性泡沫显著，配置上逐步增加了蓝筹股的配置比例，更加注重投资标的的安全边际，但净值也有一定幅度的回撤，今后在回避系统性风险上加强前瞻预判能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.110 元，本报告期份额净值增长率为 11.00%，同期比较基准的增长率为 2.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

杠杆危机对投资者的信心有所影响，但随着股票价格的调整，股票估值水平有了很大幅度的回归，很多标的的投资价值显现，本基金将更加注重精选个股，沙中淘金，追求业绩兑现的确定性，争取在下半年取得好的投资业绩回报投资者的信任。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.6.1.1 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。

4.6.1.2 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。

4.6.1.3 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。

4.6.1.4 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。

4.6.1.5 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 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人，或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对新华万银多元策略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

2015 年 8 月 24 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：新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	72,805,977.53
结算备付金		4,147,805.15
存出保证金		366,844.48
交易性金融资产	6.4.7.2	256,801,427.42
其中：股票投资		256,801,427.42
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		845,070.15
应收利息	6.4.7.3	16,662.98
应收股利		-
应收申购款		1,346,988.20
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		336,330,775.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 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		7,065,307.81
应付赎回款		37,362,788.83
应付管理人报酬		479,572.15
应付托管费		79,928.68
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.4	621,966.43
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.5	152,884.45
负债合计		45,762,448.35
所有者权益：		-
实收基金	6.4.7.6	261,742,877.80
未分配利润	6.4.7.7	28,825,449.76
所有者权益合计		290,568,327.56
负债和所有者权益总计		336,330,775.91

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年，基金净值 1.110 元，基金份额总额 261,742,877.80 份。

6.2 利润表

会计主体：新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 4 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		34,427,241.99
1.利息收入		266,173.82
其中：存款利息收入	6.4.7.8	126,356.98
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		139,816.84
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		58,610,369.76
其中：股票投资收益	6.4.7.9	57,846,548.57
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.10	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-

股利收益	6.4.7.11	763,821.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	-24,952,647.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	503,346.15
减：二、费用		2,500,055.85
1. 管理人报酬		1,152,425.74
2. 托管费		192,070.96
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.14	1,045,528.27
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.15	110,030.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,927,186.14
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,927,186.14

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 10 日（基金合同生效日）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）	301,911,140.15	-	301,911,140.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,927,186.14	31,927,186.14
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）	-40,168,262.35	-3,101,736.38	-43,269,998.73
其中：1.基金申购款	64,857,001.56	20,084,677.15	84,941,678.71
2.基金赎回款	-105,025,263.91	-23,186,413.53	-128,211,677.44
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）	261,742,877.80	28,825,449.76	290,568,327.56
-----------------	----------------	---------------	----------------

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年，无上年度可比期间数据。

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

新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会证监许可【2014】1338 号文《关于准予新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，由新华基金管理有限公司发起募集的契约型开放式混合型证券投资基金，存续期不限定。于 2015 年 3 月 9 日通过新华基金管理有限公司的直销中心和取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议代为办理基金销售业务的代销机构公开发售，发行期限：2015 年 3 月 9 日至 2015 年 4 月 8 日。首次募集资金总额 301,911,140.15 元，其中募集资金产生利息 73,476.56 元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2015]第 37100005 号验资报告予以验证。2014 年 4 月 25 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。申请发行基金募集份额不少于 2 亿份，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《新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华万银多元策略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国内依法公开发行、上市 的股票、债券及中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。本基金股票的投资比例为 0-95%，中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金或期日在一年以内的政府债券的比例合计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 2015 年 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金合同》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计入当期损益。

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计入当期损益，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计入当期损益。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 1.50% 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、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 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、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；

3、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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关有关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	72,805,977.53
定期存款	-
其他存款	-
合计	72,805,977.53

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 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 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	281,754,075.16	256,801,427.42	-24,952,647.74

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		281,754,075.16	256,801,427.42	-24,952,647.74

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	14,834.63
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,828.35
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	16,662.98

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	621,966.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	621,966.43

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	42,853.57
其他应付款	-
预提费用	110,030.88
合计	152,884.45

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	301,911,140.15	301,911,140.15
本期申购	64,857,001.56	64,857,001.56
本期赎回（以“-”号填列）	-105,025,263.91	-105,025,263.91
本期末	261,742,877.80	261,742,877.80

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	56,879,833.88	-24,952,647.74	31,927,186.14
本期基金份额交易产生的变动数	-8,440,314.64	5,338,578.26	-3,101,736.38
其中：基金申购款	11,001,420.04	9,083,257.11	20,084,677.15
基金赎回款	-19,441,734.68	-3,744,678.85	-23,186,413.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,439,519.24	-19,614,069.48	28,825,449.76

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	108,492.65
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	17,864.33

其他	-
合计	126,356.98

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.9 股票投资收益

6.4.7.9.1 股票投资收益项目构成

本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.9.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 4 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	325,803,924.66
减：卖出股票成本总额	267,957,376.09
买卖股票差价收入	57,846,548.57

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.10 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 4 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 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（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-

6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 4 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	763,821.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	763,821.19

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年4月10日（基金合同生效日）至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-24,952,647.74
——股票投资	-24,952,647.74
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-24,952,647.74

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年4月10日（基金合同生效日）至2015年6月30日
基金赎回费收入	497,894.55
转换费收入	5,451.60
合计	503,346.15

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.14 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年4月10日（基金合同生效日）至2015年6月30日
交易所市场交易费用	1,045,528.27
银行间市场交易费用	-
合计	1,045,528.27

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年4月10日（基金合同生效日）至2015年6月30日
审计费用	24,661.50
信息披露费	85,369.38
债券账户维护费	0.00
汇划手续费	0.00
其他	-

合计	110,030.88
----	------------

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 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 2015 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

沪、深交易所和中国证券登记结算公司调降 A 股交易结算相关收费标准，于 2015 年 8 月 1 日起实施。其中，沪、深证券交易所收取的 A 股交易经手费由按成交金额 0.0696‰ 双向收取，调整为按成交金额 0.0487‰ 双向收取。同时，中国证券登记结算公司收取的 A 股交易过户费由目前沪市按照成交面值 0.3‰ 双向收取、深市按照成交金额 0.0255‰ 双向收取，一律调整为按照成交金额 0.02‰ 双向收取。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害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 2015 年 4 月 10 日成立至 2015 年 6 月 30 日未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 2015 年 4 月 10 日成立至 2015 年 6 月 30 日未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 2015 年 4 月 10 日成立至 2015 年 6 月 30 日未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 2015 年 4 月 10 日成立至 2015 年 6 月 30 日未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

本基金自 2015 年 4 月 10 日成立至 2015 年 6 月 30 日未有支付关联方的佣金。

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 2015年4月10日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,152,425.74
其中：支付销售机构的客户维护费	506,687.79

注：1、基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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×1.50%/当年天数

2、本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年，无上年可比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月10日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	192,070.96

注：1、基金的托管人报酬按前一日基金资产净值 0.25%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:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

2、本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年，无上年可比数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金自 2015 年 4 月 10 日成立至报告截止日 2015 年 6 月 30 日未通过关联方进行银行间同业市场债券(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**

本基金自 2015 年 4 月 10 日成立至报告截止日 2015 年 6 月 30 日本基金管理人未运用固有资金

投资本基金。

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

本基金于 2014 年 4 月 25 日成立至 2014 年 6 月 30 日未有除本基金管理人之外的其它关联方投资本基金。

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 2015年4月10日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	72,805,977.53	108,492.65

注：本基金 2015 年 4 月 10 日成立，报告截止日 2015 年 6 月 30 日未满一年，无上年可比数据。

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

本基金自 2015 年 4 月 10 日成立，至报告截止日 2015 年 6 月 30 日无利润分配。

6.4.12 期末（2015 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/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	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000732	泰禾集团	2015-06-25	筹划员工持股计划	34.20	2015-07-02	30.58	104,800.00	3,090,038.65	3,584,160.00	-
000416	民生控股	2015-05-29	筹划重大事项	17.52	-	-	80,000.00	1,101,600.00	1,401,600.00	-
300113	顺网科技	2015-05-05	拟披露重大事	53.59	2015-08-06	51.93	78,000.00	4,637,212.00	4,180,020.00	-

			项							
600520	中发科技	2015-05-26	筹划重大事项	36.09	2015-07-24	32.48	40,000.00	1,005,600.00	1,443,600.00	-
600654	中安消	2015-06-29	拟推行员工持股计划	30.91	-	-	90,000.00	3,512,000.00	2,781,900.00	-
002354	天神娱乐	2015-05-28	拟披露重大事项	96.97	2015-07-23	87.27	10,000.00	981,899.50	969,700.00	-
300255	常山药业	2015-06-03	控股股东与公司洽谈相关重大事项	34.71	2015-07-13	31.24	55,000.00	1,173,211.28	1,909,050.00	-
600587	新华医疗	2015-05-22	控股股东筹划股权委托管理事项	50.17	2015-07-03	52.69	88,160.00	4,407,741.37	4,422,987.20	-

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

本报告期末本基金未持有银行间市场正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场正回购。

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 2015 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	72,805,977.53	-	-	-	72,805,977.53
结算备付金	4,147,805.15	-	-	-	4,147,805.15
存出保证金	366,844.48	-	-	-	366,844.48
交易性金融资产	-	-	-	256,801,427.42	256,801,427.42
应收证券清算款	-	-	-	845,070.15	845,070.15
应收利息	-	-	-	16,662.98	16,662.98
应收申购款	-	-	-	1,346,988.20	1,346,988.20
资产总计	77,320,627.16	-	-	259,010,148.75	336,330,775.91
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,065,307.81	7,065,307.81
应付赎回款	-	-	-	37,362,788.83	37,362,788.83
应付管理人报酬	-	-	-	479,572.15	479,572.15
应付托管费	-	-	-	79,928.68	79,928.68
应付交易费用	-	-	-	621,966.43	621,966.43
其他负债	-	-	-	152,884.45	152,884.45
负债总计	-	-	-	45,762,448.35	45,762,448.35
利率敏感度缺口	77,320,627.16	0.00	0.00	213,247,700.40	290,568,327.56

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2015 年 6 月 30 日	
	市场利率上升 25.00 bp		增加约 19
	市场利率下降 25.00 bp		减少约 19

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 2015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	256,801,427.42	88.38
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	-	-
合计	256,801,427.42	88.38

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 2015年6月30日
	本基金业绩比较基准上升 1%	增加约 292
	本基金业绩比较基准下降 1%	减少约 292

注：1. 本基金的整体业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%；

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	256,801,427.42	76.35
	其中：股票	256,801,427.42	76.35
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	76,953,782.68	22.88
7	其他各项资产	2,575,565.81	0.77
8	合计	336,330,775.91	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	2,438,800.00	0.84
B	采矿业	3,746,900.00	1.29
C	制造业	149,784,971.26	51.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,078,819.00	3.81
F	批发和零售业	2,724,100.00	0.94
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	34,637,089.16	11.92

J	金融业	26,448,600.00	9.10
K	房地产业	22,988,508.00	7.91
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,037,900.00	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	903,240.00	0.31
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	1,012,500.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	256,801,427.42	88.38

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	000002	万科A	720,000	10,454,400.00	3.60
2	600835	上海机电	285,000	9,387,900.00	3.23
3	000090	天健集团	371,700	9,013,725.00	3.10
4	601166	兴业银行	450,000	7,762,500.00	2.67
5	300072	三聚环保	198,520	6,690,124.00	2.30
6	002675	东诚药业	122,100	5,571,423.00	1.92
7	002271	东方雨虹	200,000	5,140,000.00	1.77
8	600476	湘邮科技	130,000	4,915,300.00	1.69
9	300439	美康生物	40,000	4,864,000.00	1.67
10	600129	太极集团	175,000	4,763,500.00	1.64
11	601601	中国太保	150,000	4,527,000.00	1.56
12	600587	新华医疗	88,160	4,422,987.20	1.52
13	600400	红豆股份	307,183	4,401,932.39	1.51
14	000926	福星股份	306,800	4,328,948.00	1.49
15	300113	顺网科技	78,000	4,180,020.00	1.44
16	600741	华域汽车	180,000	3,843,000.00	1.32
17	002042	华孚色纺	280,000	3,813,600.00	1.31
18	600446	金证股份	30,000	3,703,800.00	1.27
19	000732	泰禾集团	104,800	3,584,160.00	1.23
20	600881	亚泰集团	280,000	3,558,800.00	1.22
21	600992	贵绳股份	210,000	3,439,800.00	1.18
22	300210	森远股份	170,700	3,328,650.00	1.15
23	600332	白云山	95,000	3,273,700.00	1.13

24	000488	晨鸣纸业	350,000	3,139,500.00	1.08
25	300160	秀强股份	135,000	3,091,500.00	1.06
26	002358	森源电气	140,000	3,007,200.00	1.03
27	601318	中国平安	35,000	2,867,900.00	0.99
28	600654	中安消	90,000	2,781,900.00	0.96
29	300400	劲拓股份	60,000	2,768,400.00	0.95
30	600600	青岛啤酒	57,119	2,661,174.21	0.92
31	000555	神州信息	35,000	2,618,000.00	0.90
32	002410	广联达	110,000	2,574,000.00	0.89
33	300342	天银机电	70,000	2,565,500.00	0.88
34	601939	建设银行	350,000	2,495,500.00	0.86
35	300168	万达信息	50,000	2,456,000.00	0.85
36	600467	好当家	260,000	2,438,800.00	0.84
37	600309	万华化学	100,000	2,418,000.00	0.83
38	000976	*ST 春晖	200,000	2,358,000.00	0.81
39	002394	联发股份	150,000	2,322,000.00	0.80
40	300024	机器人	30,000	2,317,800.00	0.80
41	601998	中信银行	300,000	2,313,000.00	0.80
42	002073	软控股份	100,000	2,310,000.00	0.79
43	601169	北京银行	170,000	2,264,400.00	0.78
44	002609	捷顺科技	112,200	2,244,000.00	0.77
45	000858	五粮液	70,000	2,219,000.00	0.76
46	300004	南风股份	32,000	2,176,000.00	0.75
47	600028	中国石化	290,000	2,047,400.00	0.70
48	000971	蓝鼎控股	85,600	2,041,560.00	0.70
49	300295	三六五网	17,644	2,035,941.16	0.70
50	600987	航民股份	150,000	2,034,000.00	0.70
51	600222	太龙药业	170,000	2,031,500.00	0.70
52	600176	中国巨石	75,000	2,029,500.00	0.70
53	300255	常山药业	55,000	1,909,050.00	0.66
54	002431	棕榈园林	65,000	1,886,300.00	0.65
55	300075	数字政通	50,000	1,884,500.00	0.65
56	000333	美的集团	50,000	1,864,000.00	0.64
57	000503	海虹控股	38,000	1,862,000.00	0.64
58	000756	新华制药	150,000	1,813,500.00	0.62
59	002439	启明星辰	50,600	1,735,580.00	0.60
60	600048	保利地产	150,000	1,713,000.00	0.59
61	601857	中国石油	150,000	1,699,500.00	0.58
62	002588	史丹利	58,400	1,679,000.00	0.58
63	002115	三维通信	110,000	1,648,900.00	0.57
64	600685	广船国际	30,000	1,612,200.00	0.55
65	300273	和佳股份	52,124	1,552,773.96	0.53
66	002612	朗姿股份	23,000	1,551,350.00	0.53
67	600240	华业地产	100,000	1,526,000.00	0.53

68	600513	联环药业	52,000	1,469,520.00	0.51
69	600520	中发科技	40,000	1,443,600.00	0.50
70	000416	民生控股	80,000	1,401,600.00	0.48
71	000656	金科股份	200,000	1,382,000.00	0.48
72	300005	探路者	50,000	1,370,000.00	0.47
73	000829	天音控股	90,000	1,336,500.00	0.46
74	600271	航天信息	20,000	1,294,200.00	0.45
75	000985	大庆华科	50,000	1,287,000.00	0.44
76	300379	东方通	15,400	1,237,698.00	0.43
77	600570	恒生电子	11,000	1,232,550.00	0.42
78	000523	广州浪奇	70,000	1,208,900.00	0.42
79	300376	易事特	30,660	1,195,740.00	0.41
80	002053	云南盐化	40,000	1,148,400.00	0.40
81	000619	海螺型材	80,000	1,144,000.00	0.39
82	600105	永鼎股份	50,000	1,138,000.00	0.39
83	600036	招商银行	60,000	1,123,200.00	0.39
84	600438	通威股份	70,000	1,101,100.00	0.38
85	000678	襄阳轴承	100,000	1,099,000.00	0.38
86	300223	北京君正	30,000	1,068,000.00	0.37
87	300404	博济医药	10,000	1,037,900.00	0.36
88	002678	珠江钢琴	50,000	1,014,000.00	0.35
89	300133	华策影视	37,500	1,012,500.00	0.35
90	300253	卫宁软件	19,000	988,000.00	0.34
91	000590	*ST 古汉	40,000	978,000.00	0.34
92	601988	中国银行	200,000	978,000.00	0.34
93	002354	天神娱乐	10,000	969,700.00	0.33
94	603588	高能环境	12,000	903,240.00	0.31
95	002125	湘潭电化	43,800	883,884.00	0.30
96	300334	津膜科技	30,000	874,500.00	0.30
97	600557	康缘药业	30,000	834,900.00	0.29
98	002556	辉隆股份	40,000	800,400.00	0.28
99	300105	龙源技术	50,000	770,000.00	0.26
100	000155	*ST 川化	60,000	750,600.00	0.26
101	600958	东方证券	25,000	715,500.00	0.25
102	002152	广电运通	20,000	646,800.00	0.22
103	002236	大华股份	20,000	638,400.00	0.22
104	600287	江苏舜天	40,000	587,200.00	0.20
105	300220	金运激光	10,000	544,000.00	0.19
106	300181	佐力药业	40,000	474,400.00	0.16
107	300367	东方网力	5,686	328,366.50	0.11
108	002301	齐心集团	10,000	288,000.00	0.10
109	002009	天奇股份	10,000	247,700.00	0.09
110	002504	东光微电	6,600	178,794.00	0.06
111	002156	通富微电	6,600	123,156.00	0.04

112	300018	中元华电	400	18,080.00	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

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	002675	东诚药业	15,299,147.89	5.27
2	600835	上海机电	12,153,233.76	4.18
3	000002	万 科 A	12,133,849.00	4.18
4	000090	天健集团	11,235,949.07	3.87
5	000926	福星股份	10,355,603.98	3.56
6	600400	红豆股份	9,979,612.25	3.43
7	000555	神州信息	9,392,393.85	3.23
8	601166	兴业银行	9,181,417.80	3.16
9	002609	捷顺科技	9,101,469.00	3.13
10	600804	鹏博士	8,838,709.00	3.04
11	300329	海伦钢琴	8,596,415.85	2.96
12	300295	三六五网	8,288,330.40	2.85
13	000976	*ST 春晖	7,356,812.00	2.53
14	300439	美康生物	7,307,074.00	2.51
15	600446	金证股份	7,202,802.00	2.48
16	300210	森远股份	7,140,602.00	2.46
17	600129	太极集团	6,829,579.00	2.35
18	002504	东光微电	6,793,023.00	2.34
19	300400	劲拓股份	6,588,622.00	2.27
20	300072	三聚环保	6,564,916.74	2.26
21	002410	广联达	6,280,268.00	2.16
22	600028	中国石化	6,057,333.00	2.08
23	600741	华域汽车	5,898,086.46	2.03
24	002111	威海广泰	5,879,455.00	2.02
25	601939	建设银行	5,847,029.77	2.01

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

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	002675	东诚药业	15,791,206.80	5.43

2	600400	红豆股份	11,839,931.66	4.07
3	002609	捷顺科技	10,982,556.16	3.78
4	600804	鹏博士	10,874,737.10	3.74
5	300329	海伦钢琴	9,746,526.12	3.35
6	002504	东光微电	7,781,377.29	2.68
7	000976	*ST 春晖	7,448,141.84	2.56
8	002111	威海广泰	7,200,441.63	2.48
9	000926	福星股份	6,822,922.00	2.35
10	002355	兴民钢圈	6,593,267.00	2.27
11	000555	神州信息	6,192,040.60	2.13
12	002578	闽发铝业	6,078,472.55	2.09
13	002301	齐心集团	5,884,809.42	2.03
14	300018	中元华电	5,786,482.00	1.99
15	300295	三六五网	5,588,156.00	1.92
16	000596	古井贡酒	5,330,028.00	1.83
17	002556	辉隆股份	5,224,526.00	1.80
18	600560	金自天正	5,207,678.07	1.79
19	600835	上海机电	4,754,209.00	1.64
20	300193	佳士科技	4,711,632.18	1.62

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	549,711,451.25
卖出股票的收入（成交）总额	325,803,924.66

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

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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同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**

本基金合同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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	366,844.48
2	应收证券清算款	845,070.15
3	应收股利	-
4	应收利息	16,662.98
5	应收申购款	1,346,988.20
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,575,565.81

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处于转股期的可转换债券明细。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计之前可能存在尾差。

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
5,358	48,850.85	0.00	0.00%	261,742,877.80	100.00%

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（2015 年 4 月 10 日）基金份额总额	301,911,140.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	64,857,001.56
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	105,025,263.91
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	261,742,877.80

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

2015 年 2 月 11 日，王卫东先生因个人原因不再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

本报告无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	875,515,375.91	100.00%	621,966.43	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济商的排名。

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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		证成交总 额的比例
光大证券	-	-	1,992,800, 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	新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2015-03-05
2	新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同（摘要）	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015-03-05
3	新华万银多元策略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、证券日报、公司网站	2015-03-05
4	新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015-03-05
5	新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2015-03-05
6	新华基金管理有限公司新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015-04-11
7	新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金关于投资中国平安的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015-04-14
8	新华基金管理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	2015-05-09
9	新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015-06-04
10	新华基金：关于旗下部分基金在万银财富开通转换业务	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2015-06-05
11	新华基金管理有限公司关于暂停新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金网上直销系统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	2015-06-16
12	新华基金管理有限公司关于旗下基金参加数	中国证券报、证券时报、	2015-06-26

	米基金、众禄基金网上费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、 公司网站	
13	新华基金管理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	2015-06-30

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万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华万银多元策略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) 《新华万银多元策略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。

二〇一五年八月二十六日