

# 新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年半年度报告

### 2017 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十九日

## 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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 2017 年 8 月 28 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	错误! 未定义书签。
2.2 基金产品说明.....	错误! 未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人.....	错误! 未定义书签。
2.4 信息披露方式.....	错误! 未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	错误! 未定义书签。
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	错误! 未定义书签。
3.2 基金净值表现.....	错误! 未定义书签。
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	错误! 未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	错误! 未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	错误! 未定义书签。
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	错误! 未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	错误! 未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	错误! 未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	错误! 未定义书签。
<b>5 托管人报告</b> .....	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真实、准确和完整发表意见.....	错误! 未定义书签。
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	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。
<b>7 投资组合报告</b> .....	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。
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	错误! 未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误！未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	错误！未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	错误！未定义书签。
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	错误！未定义书签。
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	错误！未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	错误！未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变.....	错误！未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	错误！未定义书签。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	错误！未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	错误！未定义书签。
10.8 其他重大事件.....	错误！未定义书签。
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>45</b>
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录.....	错误！未定义书签。
12.2 存放地点.....	错误！未定义书签。
12.3 查阅方式.....	错误！未定义书签。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华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	新华基金管理股份有限公司
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	371,672,536.64 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		新华基金管理股份有限公司	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	010-68779688	0755-22160168
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		4008198866	95511-3
传真		010-68779528	0755-82080387

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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047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	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	谢永林

## 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	新华基金管理股份有限公司	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（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-4,891,794.29
本期利润	2,854,242.11
加权平均基金份额本期利润	0.0075
本期加权平均净值利润率	0.75%
本期基金份额净值增长率	0.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-67,386,348.93
期末可供分配基金份额利润	-0.1813
期末基金资产净值	373,348,897.99
期末基金份额净值	1.005
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.50%

### 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	3.18%	0.34%	3.04%	0.40%	0.14%	-0.06%
过去三个月	0.00%	0.35%	3.70%	0.37%	-3.70%	-0.02%
过去六个月	0.70%	0.29%	6.55%	0.34%	-5.85%	-0.05%
过去一年	6.12%	0.36%	10.36%	0.40%	-4.24%	-0.04%
自基金合同生效起至今	0.50%	1.68%	-3.58%	1.10%	4.08%	0.58%

注：1、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；

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 2017 年 6 月 30 日）



注：本报告期末，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

## 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 2017 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十七只开放式基金，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、新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）、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、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫锐混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华华盛灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫丰灵活配置混合型证券投资基金和新华鑫裕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、权益投资部总监、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、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫盛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、新华优选分红混合型证券投资基金基金经理。	2016-06-17	-	22	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、权益投资部总监、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、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华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

上半年市场风格分化明显，以业绩驱动为核心，低估值蓝筹、优质消费、周期股等板块轮番上

涨，而成长股，特别是新兴产业类板块表现一般，整体出现一定幅度下跌。报告期内，本基金仓位中性略低水平，考虑弱勢的市场环境，更加注重个股选择。配置较为均衡，精选各个行业中基本面优质的上市公司，适当加大大盘蓝筹配置比例。未来仍将以均衡配置为基础，兼顾市场热点精选主题和个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.005 元，本报告期份额净值增长率为 0.70%，同期比较基准的增长率为 6.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着供给侧改革持续推进，制造业产能过剩缓解明显，经济出现一定程度复苏迹象，全年经济下行风险不大，有利于资本市场稳定。但金融去杠杆、加强监管的持续推进，抑制了市场的风险偏好，预计市场波动仍会反复。

未来更多关注市场的结构性机会，适当加强波段操作。仓位继续保持中性略低水平，配置上更注重精选个股。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

##### 一、估值工作小组的职责分工

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

估值工作小组职责：

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

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

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

##### 二、基金会计的职责分工

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

基金会计职责：

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

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

### 三、投资管理部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询；
- 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询；
- 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，由新华基金管理股份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

2017 年 08 月 28 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	225,143,087.04	301,467,118.88
结算备付金		223,331.62	840,882.75
存出保证金		290,943.37	224,352.27
交易性金融资产	6.4.7.2	156,542,852.83	139,082,654.73
其中：股票投资		156,542,852.83	139,082,654.73
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		-	1,410,476.56
应收利息	6.4.7.5	40,943.14	61,547.50
应收股利		-	-
应收申购款		-	43,349.76
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>382,241,158.00</b>	<b>443,130,382.45</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,665,417.83	3,740,154.61
应付赎回款		108,063.44	339,058.51
应付管理人报酬		452,900.84	492,467.41
应付托管费		75,483.48	82,077.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	362,257.99	209,754.00
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	228,136.43	260,155.57
<b>负债合计</b>		<b>8,892,260.01</b>	<b>5,123,668.00</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	371,672,536.64	438,998,520.41
未分配利润	6.4.7.10	1,676,361.35	-991,805.96
<b>所有者权益合计</b>		<b>373,348,897.99</b>	<b>438,006,714.45</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>382,241,158.00</b>	<b>443,130,382.45</b>

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.005 元，基金份额总额 371,672,536.64 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>7,327,011.13</b>	<b>-15,165,656.12</b>
1.利息收入		1,002,096.89	130,112.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	966,130.04	130,112.00
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		35,966.85	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,618,042.67	-20,971,832.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,437,336.06	-21,398,616.90
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	6.4.7.18	819,293.39	426,784.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	7,746,036.40	5,657,103.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	196,920.51	18,960.18
<b>减：二、费用</b>		<b>4,472,769.02</b>	<b>1,625,231.53</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,835,475.07	872,644.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	472,579.19	145,440.83

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	936,605.89	378,405.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.22	228,108.87	228,740.53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>2,854,242.11</b>	<b>-16,790,887.65</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>2,854,242.11</b>	<b>-16,790,887.65</b>

### 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	438,998,520.41	-991,805.96	438,006,714.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,854,242.11	2,854,242.11
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）	-67,325,983.77	-186,074.80	-67,512,058.57
其中：1.基金申购款	1,495,742.45	2,774.19	1,498,516.64
2.基金赎回款	-68,821,726.22	-188,848.99	-69,010,575.21
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）	371,672,536.64	1,676,361.35	373,348,897.99
项目	上年度可比期间 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）	139,483,305.71	8,737,499.11	148,220,804.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,790,887.65	-16,790,887.65
三、本期基金份额交易产	-19,789,150.59	1,768,133.59	-18,021,017.00



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	884,618.15	-73,973.81	810,644.34
2.基金赎回款	-20,673,768.74	1,842,107.40	-18,831,661.34
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）	119,694,155.12	-6,285,254.95	113,408,900.17

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（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】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，由新华基金管理股份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股份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。2015 年 4 月 10 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股份有限公司，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%，现金或者到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股份有限公司于 2017 年 8 月 28 日批准报出。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 41 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金财务状况、经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与上年度一致、会计估计与上年度一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### 1、印花税

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。

### 2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》的规定：2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定：对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%

计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时，对个人持股 1 年以内（含 1 年）的，上市公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

## 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	225,143,087.04
定期存款	-
其他存款	-
合计	225,143,087.04

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	148,726,937.52	156,542,852.83	7,815,915.31
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	148,726,937.52	156,542,852.83	7,815,915.31

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	40,734.88
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	208.26
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	40,943.14

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	362,257.99
银行间市场应付交易费用	-
合计	362,257.99

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	27.56
其他应付款	-
预提费用	228,108.87
合计	228,136.43

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	438,998,520.41	438,998,520.41
本期申购	1,495,742.45	1,495,742.45
本期赎回（以“-”号填列）	-68,821,726.22	-68,821,726.22
本期末	371,672,536.64	371,672,536.64

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-74,090,786.82	73,098,980.86	-991,805.96
本期利润	-4,891,794.29	7,746,036.40	2,854,242.11
本期基金份额交易产生的	11,596,232.18	-11,782,306.98	-186,074.80

变动数			
其中：基金申购款	-254,644.52	257,418.71	2,774.19
基金赎回款	11,850,876.70	-12,039,725.69	-188,848.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-67,386,348.93	69,062,710.28	1,676,361.35

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	959,363.32
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	6,766.72
其他	-
合计	966,130.04

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	351,719,403.79
减：卖出股票成本总额	354,156,739.85
买卖股票差价收入	-2,437,336.06

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资。

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资。

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具投资。

#### 6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	819,293.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	819,293.39

#### 6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	7,746,036.40
——股票投资	7,746,036.40
——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	7,746,036.40

#### 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	196,895.56
转换费收入	24.95
合计	196,920.51

#### 6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	936,605.89
银行间市场交易费用	-
合计	936,605.89

**6.4.7.22 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	188,437.29
债券账户维护费	0.00
汇划手续费	0.00
其他	-
合计	228,108.87

**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 2017 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期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
新华基金管理股份有限公司	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**

本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

**6.4.10.1.1 股票交易**

本报告期及上年度可比期间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**

本报告期及上年度可比期间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**

本报告期及上年度可比期间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**

本报告期及上年度可比期间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**

本报告期及上年度可比期间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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,835,475.07	872,644.92
其中：支付销售机构的客户维护费	297,483.09	426,482.35

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提确认。计算公式为：每日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × (1.5% ÷ 当年天数)

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	472,579.19	145,440.83

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法为：每日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

本基金本报告期内未发生关联方销售服务费。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（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**

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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
平安银行股份有限公司	225,143,087.04	959,363.32	35,972,327.96	126,732.98

**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**

本基金本报告期内无利润分配。

**6.4.12 期末（2017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
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下中签	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下中签	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下中签	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下中签	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-

60361 7	君禾 股份	2017-0 6-23	2017-0 7-03	网下 中签	8.93	8.93	832.00	7,429. 76	7,429. 76	-
------------	----------	----------------	----------------	----------	------	------	--------	--------------	--------------	---

#### 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
300582	英飞特	2017-06-05	重大资产重组	18.92	2017-08-02	17.50	2,038.00	20,181.15	38,558.96	-
300065	海兰信	2016-12-08	重大事项	25.63	2017-07-06	23.07	37,500.00	899,302.14	961,125.00	-
000716	黑芝麻	2017-01-03	重大事项	8.06	2017-08-15	7.25	50,000.00	384,775.00	403,000.00	-
603336	宏辉果蔬	2017-06-21	重要事项未公告	28.40	2017-07-05	27.60	1,471.00	13,695.01	41,776.40	-
603501	韦尔股份	2017-06-05	重大资产重组	20.15	-	-	1,657.00	11,632.14	33,388.55	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重要事项未公告	16.31	2017-08-02	16.48	250,000.00	3,461,650.00	4,077,500.00	-
300088	长信科技	2016-09-12	重大事项	15.75	2017-08-09	14.50	42,400.00	599,960.00	667,800.00	-

#### 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证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面

临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	225,143,087.04	-	-	-	225,143,087.04
结算备付金	223,331.62	-	-	-	223,331.62
存出保证金	290,943.37	-	-	-	290,943.37
交易性金融资产	-	-	-	156,542,852.83	156,542,852.83
应收利息	-	-	-	40,943.14	40,943.14
资产总计	225,657,362.03	-	-	156,583,795.97	382,241,158.00
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,665,417.83	7,665,417.83
应付赎回款	-	-	-	108,063.44	108,063.44
应付管理人报酬	-	-	-	452,900.84	452,900.84
应付托管费	-	-	-	75,483.48	75,483.48
应付交易费用	-	-	-	362,257.99	362,257.99
其他负债	-	-	-	228,136.43	228,136.43
负债总计	-	-	-	8,892,260.01	8,892,260.01
利率敏感度缺口	225,657,362.03	-	-	-	-
上年度末 2016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	301,467,118.88	-	-	-	301,467,118.88
结算备付金	840,882.75	-	-	-	840,882.75
存出保证金	224,352.27	-	-	-	224,352.27
交易性金融资产	-	-	-	139,082,654.73	139,082,654.73

					3
应收证券清算款	-	-	-	1,410,476.56	1,410,476.56
应收利息	-	-	-	61,547.50	61,547.50
应收申购款	-	-	-	43,349.76	43,349.76
资产总计	302,532,353.90	-	-	140,598,028.55	443,130,382.45
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,740,154.61	3,740,154.61
应付赎回款	-	-	-	339,058.51	339,058.51
应付管理人报酬	-	-	-	492,467.41	492,467.41
应付托管费	-	-	-	82,077.90	82,077.90
应付交易费用	-	-	-	209,754.00	209,754.00
其他负债	-	-	-	260,155.57	260,155.57
负债总计	-	-	-	5,123,668.00	5,123,668.00
利率敏感度缺口	302,532,353.90	-	-	135,474,360.55	438,006,714.45

#### 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	上年度末
		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	增加约 56	增加约 76
	市场利率下降 25.00 bp	减少约 56	减少约 76

注：本基金管理人运用 XRisk Suite 风险控制系统对本基金投资组合中的银行存款、结算备付金、存出保证金和债券类资产做出以上利率风险的敏感性分析

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生

波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016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	156,542,852.83	41.93	139,082,654.73	31.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	156,542,852.83	41.93	139,082,654.73	31.75

#### 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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	本基金业绩比较基准上升 1%	-	增加约 169
	本基金业绩比较基准下降 1%	-	减少约 169

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	156,542,852.83	40.95
	其中：股票	156,542,852.83	40.95
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	225,366,418.66	58.96
7	其他各项资产	331,886.51	0.09
8	合计	382,241,158.00	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	7,628,151.70	2.04
C	制造业	123,148,578.03	32.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,703,759.48	0.72
F	批发和零售业	8,459,575.32	2.27
G	交通运输、仓储和邮政业	2,987,597.20	0.80



H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,124,202.47	0.30
J	金融业	5,582,667.60	1.50
K	房地产业	4,502,500.00	1.21
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	130,518.50	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	93,656.22	0.03
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	181,646.31	0.05
S	综合	-	-
	合计	156,542,852.83	41.93

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票投资组合。

### 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	000666	经纬纺机	635,000	14,439,900.00	3.87
2	600801	华新水泥	1,150,000	10,959,500.00	2.94
3	600519	贵州茅台	20,000	9,437,000.00	2.53
4	000688	建新矿业	946,898	7,575,184.00	2.03
5	002020	京新药业	506,200	5,998,470.00	1.61
6	603986	兆易创新	77,016	5,992,614.96	1.61
7	600809	山西汾酒	155,000	5,376,950.00	1.44
8	600821	津劝业	575,000	5,180,750.00	1.39
9	600741	华域汽车	210,000	5,090,400.00	1.36
10	600498	烽火通信	175,736	4,454,907.60	1.19
11	600985	雷鸣科化	326,500	4,221,645.00	1.13
12	600643	爱建集团	250,000	4,077,500.00	1.09
13	002244	滨江集团	500,000	3,460,000.00	0.93
14	601058	赛轮金宇	1,000,000	3,420,000.00	0.92
15	603600	永艺股份	200,000	3,292,000.00	0.88
16	002087	新野纺织	550,000	3,107,500.00	0.83

17	600392	盛和资源	200,000	2,638,000.00	0.71
18	600170	上海建工	650,000	2,483,000.00	0.67
19	600779	水井坊	100,000	2,458,000.00	0.66
20	000903	云内动力	500,000	2,275,000.00	0.61
21	002273	水晶光电	106,513	2,197,363.19	0.59
22	600115	东方航空	300,000	2,040,000.00	0.55
23	600686	金龙汽车	150,000	1,995,000.00	0.53
24	601965	中国汽研	200,000	1,878,000.00	0.50
25	600282	南钢股份	500,000	1,855,000.00	0.50
26	600976	健民集团	63,100	1,704,331.00	0.46
27	600176	中国巨石	150,000	1,647,000.00	0.44
28	600616	金枫酒业	150,000	1,603,500.00	0.43
29	600143	金发科技	250,000	1,507,500.00	0.40
30	002470	金正大	200,000	1,506,000.00	0.40
31	600309	万华化学	50,000	1,432,000.00	0.38
32	600702	沱牌舍得	50,000	1,330,500.00	0.36
33	600328	兰太实业	108,200	1,259,448.00	0.34
34	600183	生益科技	100,000	1,234,000.00	0.33
35	600056	中国医药	45,000	1,167,750.00	0.31
36	000333	美的集团	25,000	1,076,000.00	0.29
37	600201	生物股份	30,000	1,067,100.00	0.29
38	000540	中天金融	150,000	1,042,500.00	0.28
39	002126	银轮股份	100,000	1,006,000.00	0.27
40	600667	太极实业	140,000	975,800.00	0.26
41	300065	海兰信	37,500	961,125.00	0.26
42	000525	红太阳	50,000	930,500.00	0.25
43	600179	安通控股	50,000	874,500.00	0.23
44	002036	联创电子	50,000	825,000.00	0.22
45	600771	广誉远	20,000	799,000.00	0.21
46	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.21
47	600837	海通证券	50,000	742,500.00	0.20
48	601689	拓普集团	20,000	669,800.00	0.18
49	300088	长信科技	42,400	667,800.00	0.18
50	000026	飞亚达 A	50,000	622,000.00	0.17
51	601328	交通银行	100,000	616,000.00	0.16
52	600287	江苏舜天	69,700	545,054.00	0.15
53	300408	三环集团	25,000	524,750.00	0.14
54	300588	熙菱信息	13,380	465,490.20	0.12
55	300160	秀强股份	50,000	448,500.00	0.12
56	000716	黑芝麻	50,000	403,000.00	0.11
57	300318	博晖创新	50,000	354,000.00	0.09
58	300233	金城医药	16,482	345,957.18	0.09
59	002821	凯莱英	4,586	334,640.42	0.09
60	601212	白银有色	39,958	325,258.12	0.09

61	603858	步长制药	4,020	287,992.80	0.08
62	603626	科森科技	2,495	162,624.10	0.04
63	002833	弘亚数控	2,743	160,465.50	0.04
64	300223	北京君正	6,500	158,275.00	0.04
65	002831	裕同科技	2,108	158,100.00	0.04
66	002839	张家港行	9,330	146,667.60	0.04
67	601952	苏垦农发	10,425	144,594.75	0.04
68	603881	数据港	2,877	140,455.14	0.04
69	300097	智云股份	5,000	135,000.00	0.04
70	603708	家家悦	7,636	125,612.20	0.03
71	002841	视源股份	1,680	124,689.60	0.03
72	603165	荣晟环保	1,767	117,240.45	0.03
73	601366	利群股份	8,400	116,760.00	0.03
74	603225	新凤鸣	3,197	115,667.46	0.03
75	603337	杰克股份	2,833	109,637.10	0.03
76	603098	森特股份	4,293	99,082.44	0.03
77	603660	苏州科达	2,353	96,355.35	0.03
78	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.02
79	601858	中国科传	7,280	91,145.60	0.02
80	603358	华达科技	1,768	89,566.88	0.02
81	603877	太平鸟	3,180	89,008.20	0.02
82	300568	星源材质	2,096	88,975.20	0.02
83	603189	网达软件	3,898	83,729.04	0.02
84	300569	天能重工	2,365	83,129.75	0.02
85	300583	赛托生物	1,582	82,200.72	0.02
86	603113	金能科技	3,496	81,526.72	0.02
87	002823	凯中精密	3,863	81,123.00	0.02
88	002812	创新股份	990	80,190.00	0.02
89	603186	华正新材	1,874	80,150.98	0.02
90	603577	汇金通	2,460	75,743.40	0.02
91	603298	杭叉集团	3,641	75,477.93	0.02
92	002845	同兴达	1,048	75,246.40	0.02
93	603228	景旺电子	1,559	75,221.75	0.02
94	002848	高斯贝尔	2,500	74,525.00	0.02
95	603385	惠达卫浴	2,750	73,672.50	0.02
96	603032	德新交运	1,628	73,097.20	0.02
97	603239	浙江仙通	2,772	72,155.16	0.02
98	300570	太辰光	3,258	71,513.10	0.02
99	603920	世运电路	3,125	70,062.50	0.02
100	603777	来伊份	1,720	63,863.60	0.02
101	002832	比音勒芬	1,158	63,771.06	0.02
102	603728	鸣志电器	2,719	63,434.27	0.02
103	300610	晨化股份	2,694	63,228.18	0.02
104	300600	瑞特股份	1,123	62,551.10	0.02

105	603360	百傲化学	2,071	62,109.29	0.02
106	300558	贝达药业	1,029	61,369.56	0.02
107	603638	艾迪精密	1,675	59,764.00	0.02
108	603900	通灵珠宝	1,893	59,686.29	0.02
109	603826	坤彩科技	3,299	59,579.94	0.02
110	300602	飞荣达	1,254	59,301.66	0.02
111	300601	康泰生物	2,109	59,178.54	0.02
112	603218	日月股份	1,652	58,546.88	0.02
113	603639	海利尔	1,086	57,688.32	0.02
114	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.02
115	603628	清源股份	2,581	57,556.30	0.02
116	603637	镇海股份	1,802	56,474.68	0.02
117	300580	贝斯特	2,489	56,251.40	0.02
118	002847	盐津铺子	1,553	56,218.60	0.02
119	300599	雄塑科技	3,155	55,843.50	0.01
120	603896	寿仙谷	1,392	54,301.92	0.01
121	603096	新经典	1,270	53,822.60	0.01
122	300565	科信技术	2,382	53,356.80	0.01
123	603177	德创环保	2,779	52,967.74	0.01
124	603505	金石资源	2,570	52,967.70	0.01
125	603690	至纯科技	3,106	52,895.18	0.01
126	603266	天龙股份	1,562	52,873.70	0.01
127	603416	信捷电气	1,507	52,760.07	0.01
128	603067	振华股份	2,616	52,555.44	0.01
129	603803	瑞斯康达	2,245	52,016.65	0.01
130	002846	英联股份	1,492	51,921.60	0.01
131	603928	兴业股份	2,670	51,264.00	0.01
132	300596	利安隆	2,319	49,997.64	0.01
133	002827	高争民爆	2,059	49,621.90	0.01
134	603929	亚翔集成	2,193	49,386.36	0.01
135	603081	大丰实业	2,582	49,006.36	0.01
136	603050	科林电气	1,256	48,933.76	0.01
137	603987	康德莱	3,169	48,929.36	0.01
138	603258	电魂网络	1,182	48,509.28	0.01
139	603313	梦百合	1,498	48,055.84	0.01
140	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
141	603585	苏利股份	1,353	46,610.85	0.01
142	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
143	300597	吉大通信	2,646	45,405.36	0.01
144	002849	威星智能	1,060	45,262.00	0.01
145	002824	和胜股份	1,816	45,036.80	0.01
146	603758	秦安股份	2,441	45,036.45	0.01
147	300552	万集科技	1,349	44,247.20	0.01
148	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01

149	603819	神力股份	1,698	42,959.40	0.01
150	300541	先进数通	1,466	42,733.90	0.01
151	603886	元祖股份	2,178	42,732.36	0.01
152	300591	万里马	3,115	42,675.50	0.01
153	603855	华荣股份	2,728	41,792.96	0.01
154	603336	宏辉果蔬	1,471	41,776.40	0.01
155	603668	天马科技	2,821	41,581.54	0.01
156	002819	东方中科	1,293	41,518.23	0.01
157	002835	同为股份	2,252	41,436.80	0.01
158	002843	泰嘉股份	1,377	40,979.52	0.01
159	603797	联泰环保	2,137	40,688.48	0.01
160	603421	鼎信通讯	1,452	40,641.48	0.01
161	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.01
162	300593	新雷能	1,519	40,086.41	0.01
163	300556	丝路视觉	1,226	40,053.42	0.01
164	603767	中马传动	1,785	39,751.95	0.01
165	002825	纳尔股份	1,139	39,352.45	0.01
166	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.01
167	300587	天铁股份	1,438	38,567.16	0.01
168	300582	英飞特	2,038	38,558.96	0.01
169	002842	翔鹭钨业	932	38,118.80	0.01
170	300606	金太阳	1,228	38,080.28	0.01
171	603060	国检集团	1,535	38,037.30	0.01
172	601882	海天精工	2,148	37,332.24	0.01
173	603926	铁流股份	1,082	36,712.26	0.01
174	300592	华凯创意	1,583	36,678.11	0.01
175	002838	道恩股份	1,021	36,551.80	0.01
176	603787	新日股份	1,850	36,204.50	0.01
177	300548	博创科技	754	36,154.30	0.01
178	603383	顶点科技	811	36,138.16	0.01
179	603859	能科股份	1,121	36,006.52	0.01
180	300609	汇纳科技	1,037	35,537.99	0.01
181	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
182	603042	华脉科技	1,232	35,013.44	0.01
183	603389	亚振家居	1,963	34,607.69	0.01
184	300603	立昂技术	1,034	33,894.52	0.01
185	603388	元成股份	892	33,512.44	0.01
186	603538	美诺华	1,122	33,480.48	0.01
187	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.01
188	603196	日播时尚	2,083	32,682.27	0.01
189	603089	正裕工业	1,087	32,544.78	0.01
190	603041	美思德	1,034	31,340.54	0.01
191	300542	新晨科技	988	30,598.36	0.01
192	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.01

193	300589	江龙船艇	1,189	29,201.84	0.01
194	300605	恒锋信息	916	29,128.80	0.01
195	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.01
196	300586	美联新材	1,006	28,117.70	0.01
197	603139	康惠制药	910	27,181.70	0.01
198	603229	奥翔药业	1,340	26,558.80	0.01
199	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
200	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.01
201	603269	海鸥股份	795	23,357.10	0.01
202	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
203	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
204	300537	广信材料	998	20,578.76	0.01
205	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
206	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
207	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
208	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
209	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
210	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
211	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
212	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	000666	经纬纺机	13,542,962.89	3.09
2	600801	华新水泥	9,913,614.00	2.26
3	600109	国金证券	9,225,180.00	2.11
4	600028	中国石化	8,558,000.00	1.95
5	601211	国泰君安	8,442,055.00	1.93
6	601669	中国电建	8,430,000.00	1.92
7	600519	贵州茅台	8,389,863.00	1.92
8	002244	滨江集团	8,353,610.00	1.91
9	600581	八一钢铁	8,110,848.50	1.85
10	600976	健民集团	8,107,151.55	1.85
11	601225	陕西煤业	7,737,724.00	1.77
12	600809	山西汾酒	7,540,143.42	1.72
13	000688	建新矿业	7,325,353.84	1.67
14	600718	东软集团	7,165,135.08	1.64
15	000807	云铝股份	6,519,835.00	1.49

16	600498	XD 烽火通	6,395,795.92	1.46
17	603986	兆易创新	6,124,242.56	1.40
18	600821	津劝业	6,060,396.99	1.38
19	601688	华泰证券	5,839,521.00	1.33
20	002020	京新药业	5,801,701.01	1.32

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	600963	岳阳林纸	12,611,752.34	2.88
2	600028	中国石化	8,580,000.00	1.96
3	600581	八一钢铁	8,409,946.49	1.92
4	601669	中国电建	8,407,000.00	1.92
5	601211	国泰君安	8,337,014.00	1.90
6	600109	国金证券	8,116,295.00	1.85
7	000948	南天信息	7,578,280.99	1.73
8	601225	陕西煤业	7,297,781.84	1.67
9	600718	东软集团	7,268,244.89	1.66
10	000018	神州长城	6,976,645.75	1.59
11	000807	云铝股份	5,799,087.00	1.32
12	000581	威孚高科	5,779,036.00	1.32
13	601688	华泰证券	5,767,837.69	1.32
14	600976	健民集团	5,409,915.00	1.24
15	000858	五粮液	5,329,397.60	1.22
16	600240	华业资本	5,184,631.00	1.18
17	000651	格力电器	4,683,430.00	1.07
18	002051	中工国际	4,392,865.60	1.00
19	000423	东阿阿胶	4,351,741.00	0.99
20	002244	滨江集团	4,319,114.00	0.99

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	363,870,901.55
卖出股票的收入（成交）总额	351,719,403.79

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投资。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期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投资。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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	290,943.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,943.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	331,886.51

#### 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。

#### 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不存在流通受限情况。

#### 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
8,801	42,230.72	298,000,946.60	80.18%	73,671,590.06	19.82%

**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	1.07	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
本报告期期初基金份额总额	438,998,520.41
本报告期基金总申购份额	1,495,742.45
减：本报告期基金总赎回份额	68,821,726.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	371,672,536.64

**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**

2017 年 2 月 17 日，林艳芳女士离任本基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告无涉及基金管理人、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	
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	363,914,225.16	51.02%	266,130.48	51.02%	-
方正证券	2	349,352,875.32	48.98%	255,480.63	48.98%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金报告期内共租用6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
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

### 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	2017-01-17
2	新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金 2016 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	2017-01-20
3	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回及最低持有份额的数额限制的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-02-15
4	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	2017-02-18
5	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金增加蚂蚁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	2017-02-27
6	新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资	中国证券报、证券时报、	2017-03-31

	基金 2016 年年度报告	上海证券报、证券日报、 公司网站	
7	新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 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	2017-04-21
8	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（更新）全文	公司网站	2017-05-24
9	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（更新）摘要	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-05-24
10	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-05-27

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	104,710,994.76	0.00	0.00	104,710,994.76	28.17%
产品特有风险							
<p>1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

### 11.2 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) 新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六) 更新的《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) 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

二〇一七年八月二十九日