新华活期添利货币市场基金

【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华活期添利货币
基金主代码	000903
交易代码	000903
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月4日
报告期末基金份额总额	123,082,127.80份
投资目标	在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金采取以长期利率趋势分析为基础,结合短中期经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券类属配置和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资组合管理
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:人民币七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其预期风险与预期收益均低于一般债券基金,也低于混合型基金与股票型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	5,526,087.58
2.本期利润	5,526,087.58
3.期末基金资产净值	123,082,127.80

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金自2014年12月4日成立,至2015年6月30日披露日未满一年。

3.本基金利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

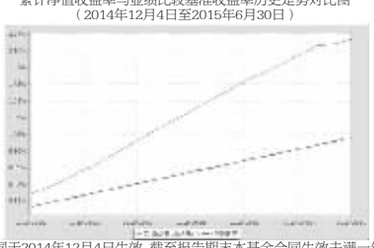
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.9230%	0.0032%	0.3371%	0.0000%	0.5859%	0.0032%

注:本基金利润分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华活期添利货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年12月4日至2015年6月30日)



注:1.本基金合同于2014年12月4日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2.本报告期,本基金建仓期结束,各项资产比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
姚秋	本基金基金经理、新华阿里一号保本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、新华财富金30天理财债券型证券投资基金基金经理、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。	2014-12-04	-	2	经济学博士、注册金融分析师,历任于中国建设银行北京分行投资银行部从事投资研究工作。中国工商银行资产管理部固定收益投资经理。2014年4月加入新华基金管理有限公司,现任新华阿里一号保本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、新华财富金30天理财债券型证券投资基金基金经理、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,新华基金管理有限公司作为新华活期添利货币市场基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华活期添利货币市场基金基金合同》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 公平交易专项说明

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,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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2015年二季度,经济探底后趋势性企稳,但下行风险并未消除。前5月固定资产投资累计同比增长11.4%,同比增速继续放缓。新开工低迷使得房地产投资弱势,资金约束下基建投资放缓,固定资产投资继续下行。消费品通胀低位徘徊,工业品通胀紧缩仍在持续,难以对债券收益率大幅反弹提供支持。财政政策持续向"稳增长"倾斜,货币政策力度加大。虽然制造业总体低迷,但房地产投资企稳;并随着地方债务置换和城投债借新还旧的逐步放开,稳增长宽信用再进一步,经济在地方债和平台双轮驱动下,逐渐企稳的可能性提升。

2015年二季度债市短端收益率快速下行,长端处于区间震荡行情,收益率快速下行后反弹至二季度初期水平,收益率曲线更加陡峭化:4-5月中旬,基本面低于预期,经济下行压力仍然较大,货币宽松再度发力,叠加资金利率大幅下行,债券收益率快速下行。5月中旬至6月,资金依旧宽松,短端持续下行;地方债发行顺利推进,供给持续放量,同时各类稳增长措施密集出台,且偏向疏通信用传导,供给压力叠加经济预期变化,长端面临较大的上行压力,导致长端上扬,曲线陡峭化加剧。

本基金二季度配置以存款为主,受IPO及股市波动的影响,期间基金份额规模缩减较快,收益率波动下降。

4.5报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内基金份额净值收益率为0.9230%,同期业绩比较基准收益率为0.3371%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年三季度,资金面延续宽松行情,三季度资金价格将维持在低位,套息空间稳定,短端仍然不乏机会。长端收益率区间震荡行情或将延续。经济逐渐企稳的可能性进一步上升,稳增长宽信用再进一步,经济底部风险有望进一步收敛,利率长端底部夯实;同时,受制于国内外需求不足、房地产投资滞后于销售、财政政策空间受限等因素影响,经济难以实现V型反转,收益率暂不具备趋势性上行条件,长端利率上有顶下有底。

我们认为三季度债市将呈震荡行情,与此同时权益市场的剧烈波动带来了持有人的频繁申赎,将结合债券市场表现与组合的流动性要求,采取较为灵活的策略应对债市波动。

本基金三季度配置将继续重点把握资金面波动时点,投向短融等货币市场工具,在确保组合流动性的前提下,提高基金持有人的投资回报率。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	79,977,916.79	64.63
	其中:债券	79,977,916.79	64.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	10,000,135.00	8.08
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	31,569,866.25	25.51
4	其他各项资产	2,200,496.20	1.78
5	合计	123,748,414.24	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	-	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	121
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	2

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	17.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	64.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	16.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		98.74	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	79,977,916.79	64.98
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	79,977,916.79	64.98
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011599364	15夏国贸SCP005	100,000.00	9,999,095.00	8.12
2	071543004	15金元证券CP004	100,000.00	9,998,036.13	8.12
3	071545003	15瑞银CP03	100,000.00	9,997,859.86	8.12
4	041560054	15浪奇CP001	100,000.00	9,997,700.19	8.12
5	071540003	15东吴证券CP003	100,000.00	9,996,976.53	8.12
6	011515007	15中铝业SCP007	100,000.00	9,996,581.17	8.12
7	011599372	15大唐新能SCP001	100,000.00	9,995,956.02	8.12
8	041559041	15青松CP001	100,000.00	9,995,711.89	8.12

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0359%
报告期内偏离度的最低值	-0.0327%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0063%

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

(1)基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际协议利率逐日计提利息;

(2)基金持有的回购协议(封闭式回购)以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;

(3)基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(4)基金持有的买断式回购以协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时,若双方都能履约,则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产,实际持有的相关资产按其性质进行估值;

(5)基金持有的资产支持证券视同债券,购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

5.8.2本报告期内本基金未持有剩余期限超过397天的浮动利率债券。

5.8.3本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	140,886.15
4	应收申购款	2,059,610.05
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,200,496.20

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,160,648,092.78
本报告期基金总申购份额	255,590,532.10
本报告期基金总赎回份额	1,293,156,497.08
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	123,082,127.80

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内未有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华活期添利货币市场基金募集的文件
(二)关于申请募集新华活期添利货币市场基金之法律意见书
(三)《新华活期添利货币市场基金托管协议》
(四)《新华活期添利货币市场基金基金合同》
(五)《新华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
(六)更新的《新华活期添利货币市场基金招募说明书》
(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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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
二〇一五年七月二十日

新华灵活主题股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华灵活主题股票
基金主代码	519099
交易代码	519099
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7月13日
报告期末基金份额总额	111,618,658.62份
投资目标	以主题投资为核心,前瞻性挖掘市场的长期主题趋势,动态把握市场阶段性的主题转换,并精选获益程度高的主题个股进行投资,在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续、稳定增长。
投资策略	本基金以战略性与战术性资产配置策略为指导,围绕市场的长期性和阶段性投资主题进行动态配置,并精选获益程度最高的主题个股群进行重点投资。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率 + 20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的较高预期风险收益品种,预期风险和收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	19,507,278.92
2.本期利润	5,979,183.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.2486
4.期末基金资产净值	225,020,361.93
5.期末基金份额净值	2.016

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	6.44%	3.02%	8.86%	2.09%	-2.42%	0.93%

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

新华灵活主题股票型证券投资基金
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
(2011年7月13日至2015年6月30日)

注:本报告期,本基金各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
孔雪梅	本基金基金经理、研究部总监、新华优选消费股票型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华阿里一号保本混合型证券投资基金基金经理。	2014-01-02	2015-06-15	7	管理学硕士,于2008年3月加入新华基金管理有限公司,负责行业研究。历任新华基金管理有限公司研究部总监、新华优选消费股票型证券投资基金基金经理、新华灵活主题股票型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华阿里一号保本混合型证券投资基金基金经理。
李会忠	本基金基金经理、新华基金管理有限公司金融工程部副总监、新华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-06-11	-	8	经济学硕士,8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、新华铂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、新华鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题股票型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理有限公司作为新华灵活主题股票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》、《新华灵活主题股票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 公平交易专项说明

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,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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年上半年,在转型、改革、去产能、加杠杆的大背景下,股市高歌猛进、一路上扬,频频突破各个整数关口,最高涨至5000点以上。但伴随着6月初以来的股市去杠杆,行情直转急下,短短一个月左右的时间"腰斩"个股遍地都是,且股市呈现大面积连续跌停情况,股灾爆发。我们坚信中国的转型、改革之路,坚信改革牛长期存在,在上半年重点配置了新经济、国企改革、重组股等领域,取得了较好的收益,但在6月份,伴随着市场的下行,基金较大幅度的回撤也再所难免。此次去杠杆引致的股灾,属于我们之前没有遇到的新事物,应对上不够成熟,但我们将深刻总结此次下跌的经验教训,力争以后遇到这种情况会更好的应对。

4.5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2.016元,本报告期份额净值增长率为6.44%,同期比较基准的增长率为8.86%。

4.6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,我们认为市场短期和中长期均有巨大的机会,转型和改革主导的牛市将更加坚实有序。股市的调整给我们带来了低位吸纳优质"筹码"的良机,我们将优选那些质地好、有业绩、估值低、符合转型和改革大方向的股票进行配置。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金从2015年4月1日至2015年5月19日连续33个工作日基金资产净值低于五千万。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	43,711,351.36	18.90
	其中:股票	43,711,351.36	18.90
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	7,375,573.51	3.19
7	其他资产	180,196,692.06	77.91
8	合计	231,283,616.93	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	392,832.00	0.17
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,409,319.25	13.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	618,776.00	0.27
E	建筑业	2,275,740.00	1.01
F	批发和零售业	462,300.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	897,758.40	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,528,947.71	2.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,588,064.00	1.59
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	1,109,400.00	0.49
S	综合	428,214.00	0.19
	合计	43,711,351.36	19.43

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002367	康力电梯	80,000	1,672,000.00	0.74
2	300161	华中数控	50,300	1,522,581.00	0.68
3	002081	金螳螂	54,000	1,522,260.00	0.68
4	002609	捷顺科技	67,600	1,352,000.00	0.60
5	002739	万达院线	5,000	1,109,400.00	0.49
6	002290	禾盛新材	28,000	1,004,920.00	0.45
7	600486	扬农化工	25,900	931,882.00	0.41
8	300099	尤洛卡	39,400	923,536.00	0.41
9	600503	华丽家族	52,700	916,980.00	0.41
10	600115	东方航空	72,870	897,758.40	0.40

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2本报告期,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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	122,325.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,309.96
5	应收申购款	180,072,056.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	180,196,692.06

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300161	华中数控	1,522,581.00	0.68	筹划重大事项
2	300099	尤洛卡	923,536.00	0.41	筹划重大事项
3	002367	康力电梯	1,672,000.00	0.74	筹划重大事项
4	002739	万达院线	1,109,400.00	0.49	筹划重大事项

5.11.6 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,分项之和与合计之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	28,048,291.82
本报告期基金总申购份额	104,142,200.78
减:本报告期基金总赎回份额	20,571,833.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	111,618,658.62

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华灵活主题股票型证券投资基金募集的文件
(二)关于申请募集新华灵活主题股票型证券投资基金之法律意见书
(三)《新华灵活主题股票型证券投资基金托管协议》
(四)《新华灵活主题股票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)更新的《新华灵活主题股票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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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
二〇一五年七月二十日

新华趋势领航股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华趋势领航股票
基金主代码	519158
交易代码	519158
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月11日
报告期末基金份额总额	690,991,626.83份
投资目标	把握整体市场和行业中的趋势机会,精选具有盈利增长趋势以及股票价格趋势的优质上市公司进行投资,在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续、稳定增长。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的主动投资策略,深入分析并积极跟踪驱动股票市场、债券市场、行业板块、公司股价形成上升趋势的根本性因素,通过前瞻性地把握市场中存在的趋势机会,完成本基金的大类资产配置、行业配置、债券类属品种配置以及投资组合的最终构建。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率 +20%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金是股票型基金,预期风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	196,520,641.34
2.本期利润	197,096,061.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.3612
4.期末基金资产净值	1,686,695,631.99
5.期末基金份额净值	2.441

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),记入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	31.87%	2.67%	8.86%	2.09%	23.01%	0.58%

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

新华趋势领航股票型证