

新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

2018年6月30日
基金管理人：新华基金管理股份有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年七月十九日

§ 1 要提请

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

§ 2 基金概况

基金托管人中农银行业股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月6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。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 3 基金产品概况

基金名称 新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 519195

交易代码 519195

基金份额类别 指向沪深两市的股票型基金

基金合同生效日 2014/4/23

报告期末基金份额总额 17,360,753.63份

投资目标 通过合理的资产配置，在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续增长，力争为投资者提供稳定的绝对回报。

投资策略 本基金将大类资产配置策略与个股精选策略相结合，采取积极的投资策略和持股策略，以获取稳定的收益。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×50%+国债收益率×50%

风险收益特征 本基金为混合型基金，属证券投资基金中的中等风险收益品种，预期风险收益水平低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金。

基金管理人 新华基金管理股份有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

§ 4 管理人报告

4.1 本报告期基金管理人对本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内，基金管理人根据公司《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金的管理人报告》（《中华人民共和国证券投资基金法》）、《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则和运用基金资产，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，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 公平交易专项说明

4.3 平交制度执行的情况

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》（2010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》，制度的范围包括但不限于股票、债券的一级市场申购、二级市场价格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、交易执行及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，并启动交易系统公平交易模块。根据公司制度，严格执行不同投资组合之间以及对对方的交易，严格控制不同投资组合之间的日均反向交易。

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

资组合的申购金额、净申购净值增长率以及其同期业绩比较基准收益率的比较

4.4 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.5 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.6 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.7 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.8 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.9 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.10 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.11 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.12 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.13 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.14 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.15 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.16 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.17 报告期基金净值增长率变化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② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个季度 -0.84% 12.8% -4.28% 0.57% 34.4% 0.71%

322 日基金合同生效以来以基金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

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，本期利润与本期已实现收益之差即为本期的未实现收益变动金额；
2.以上述基金业业绩指标不能代替持有人认购或交易本基金的各项费用（如申购基金时申购费用、赎回费用等），持有人实际收益水平将低于所列数字；
3.本基金净值表现。

4.18 报告期基金净值增长率变化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