

新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十日

重要提示
基金管理人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。

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年10月1日至2018年12月31日)
Rows include: 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.本期基金份额净值增长率, etc.

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;

4.1 基金经理或基金经理小组简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职起始日期, 任职截止日期, 证券从业年限, 说明

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,新华基金管理股份有限公司作为新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鑫泰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。

4.1 基金经理或基金经理小组简介

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。

4.2 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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

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

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

本报告期末本基金未投资股指期货。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.12 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.12.1 存出保证金 188,022.23

5.12.2 应收证券清算款 2,798,747.27

5.12.3 应收股利 79,186.52

5.12.4 应收利息 49,108.00

5.12.5 待摊费用 -

5.12.6 其他 -

5.12.7 合计 3,104,063.01

5.14 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。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明。

5.16 投资组合报告附注的其他重要信息

5.16.1 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.2 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.3 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.4 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.5 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.6 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.7 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.8 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.9 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.10 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.11 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.12 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.13 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.14 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.15 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.16 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.17 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.18 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.19 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.20 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.21 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.22 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.23 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.24 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.25 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.26 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.27 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.28 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.29 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.30 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.31 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.32 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.33 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.34 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.35 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.36 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.37 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.38 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.39 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.40 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.41 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

5.16.42 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

注:报告期内本基金的各项资产配置比例符合基金合同的约定。

4.1 基金经理或基金经理小组简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职起始日期, 任职截止日期, 证券从业年限, 说明

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,新华基金管理股份有限公司作为新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鑫益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。

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。

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公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.1 基金经理或基金经理小组简介

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。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 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。

4.2.2 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公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交超过该证券当日成交量的5%的情况。

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。

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公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

Table with 5 columns: 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(%)

4.6 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。

4.7 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债券投资

Table with 5 columns: 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(%)

4.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

4.9 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

4.10 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

本基金本报告期末未持有权证。

4.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期末本基金未投资股指期货。

4.12 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。

4.13 投资组合报告附注

4.13.1 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。

4.13.2 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。

4.14 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

4.14.1 存出保证金 188,022.23

4.14.2 应收证券清算款 2,798,747.27

4.14.3 应收股利 79,186.52

4.14.4 应收利息 49,108.00

4.14.5 待摊费用 -

4.14.6 其他 -

4.14.7 合计 3,104,063.01

4.14.8 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。

4.14.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明。

4.14.10 投资组合报告附注的其他重要信息

4.14.10.1 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.2 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.3 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.4 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.5 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.6 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.7 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.8 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.9 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.10 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.11 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.12 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.13 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.14 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.15 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.16 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.17 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.18 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.19 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.20 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.21 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.22 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.23 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.24 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.25 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.26 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.27 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.28 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.29 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.30 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.31 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.32 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.33 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.34 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.35 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.36 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.37 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.38 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.39 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.40 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.41 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.42 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.43 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.44 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.45 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.46 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.47 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.48 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.49 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.50 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.51 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.52 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.53 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.54 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.55 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.56 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.57 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.58 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.59 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.60 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.61 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.62 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.63 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.64 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.65 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.66 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.67 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.68 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.69 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.70 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.71 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.72 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.73 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.74 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.75 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例

4.14.10.76 报告期末本基金投资组合公允价值占基金资产净值比例