

新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 (更新)摘要

基金管理人:新华基金

基金托管人:招商银行

重要提示

新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2017年4月12日证监许可【2017】1600号文准予注册。本基金的基金合同于2017年9月9日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或保证。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,自主判断基金的投资价值,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险,包括市场风险、信用风险、流动性风险、交易对手违约风险、管理风险、资产配置风险、不可抗力风险。本基金的特定风险和其他风险。本基金投资于中小企业私募债券将会面临信用风险和流动性风险。信用风险主要是由目前国内中小企业的发育状况所导致的发行主体违约、不按约定支付本金或利息的风险;流动性风险主要是由债券非公开发行和转让所导致的无法按照合理的价格及时变现的风险。由于中小企业私募债券的特殊性,本基金的总体风险将有所提高。

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型基金。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金份额前应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证投资者基金一定盈利,也不保证投资者最低收益。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2019年2月9日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日(财务数据经会计师事务所审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:新华基金管理股份有限公司
住所:重庆江北北区聚贤岩76号力帆中心2号办公楼第19层
办公地址:北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座
重庆江北北区聚贤岩76号力帆中心2号办公楼第19层
法定代表人:陈重
设立日期:2004年12月9日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:证监基金字【2004】197号
注册资本:贰亿肆仟柒佰伍拾万元人民币
联系人:齐岩
电话:(010)189779666
传真:(010)189775628
股权结构:

股东名称	出资额(万元)	占注册资本比例
新华证券股份有限公司	11,760	68.62%
新华信托股份有限公司	7,280	38.21%
新华资产管理股份有限公司	1,280	6.17%
合计	20,320	100%

(二)主要人员情况

1.董事会成员
陈重先生:董事长,金融学博士。历任原国家经委中国企业家协会常务理事、副主任,中国企业家报社社长,中国企业家协会基金秘书长,重庆市政府副秘书长,中国企业联合会常务副理事长,享受国务院特殊津贴专家。现任新华基金管理股份有限公司董事长。
张友友先生:董事,硕士。历任内蒙古证券有限责任公司营业部总经理、太平洋证券有限责任公司副总经理、恒泰证券股份有限公司副总经理。现任新华基金管理股份有限公司总经理。

胡波先生:独立董事,博士。曾任中国人民大学财政金融学院教授、中国人民大学股权投资发展研究中心研究员、副主任。现任中国人民大学财政金融学院副教授。
宋敏女士:独立董事,硕士。历任四川省资阳市人民法院法官、中国电子系统工程总公司法务人员、北京市中济律师事务所律师、北京市东清律师事务所律师。现任北京保利威律师事务所合伙人。
张冀龙先生:独立董事,硕士。曾在山西省临汾地区教育学院教授。现任职于北京大学法学院。

2.监事会成员
杨薇女士:监事会主席,硕士。历任航天科工财务公司结算部经理、航天科工财务公司风险管理部经理、航天科工财务公司总会计师、总法律顾问、董秘、副总裁,华信亿联(北京)科贸有限公司财务总监。现任恒泰证券股份有限公司财务总监。
张浩先生:职工监事,硕士。历任长盛基金管理有限公司信息技术部副总监,长盛基金管理有限公司风险管理部副总监,合众资产管理股份有限公司风险管理部总监,富宝信(北京)投资管理有限公司总经理。现任新华基金管理有限公司监察稽核部总监。

3.高级管理人员
陈重先生:董事长,简历同上。
张友友先生:总经理,简历同上。
徐德辉先生:副总经理,学士。历任上海君创财经顾问有限公司并购部经理、上海力矩实业投资管理有限公司并购部经理、新时代证券有限责任公司投行项目经理,新华基金管理股份有限公司总经理助理兼运作保障部总监。现任新华基金管理股份有限公司副总经理。
晏益民先生:副总经理,学士。历任大通证券股份有限公司综合部副经理,泰信基金机构管理部副经理,天治基金北京分公司总经理,天治基金总经理助理,新华基金总经理助理。现任新华基金管理有限公司副总经理。

崔建波先生:副总经理,经济学硕士。历任天津中融证券投资咨询公司研究员,申银万国天津证券营业部投资经理助理,海融资讯系统有限公司研究员,和信信息科技有限公司证券研究员,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,新华基金管理股份有限公司总经理助理。现任新华基金管理有限公司副总经理兼投资总监,基金经理。
齐岩先生:督察长,学士。历任中信证券股份有限公司解放北路营业部职员,天津津源职员,天津天大管业股份有限公司经理。现任新华基金管理股份有限公司督察长兼任子公司北京新华富时资产管理有限公司董事。

4.基金经理
崔建波先生:经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员,申银万国天津证券营业部投资经理助理,海融资讯系统有限公司研究员,和信信息科技有限公司证券研究员,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,新华基金管理股份有限公司总经理助理。现任新华基金管理有限公司副总经理兼投资总监,基金经理。
李健红先生:督察长,学士。历任中信证券股份有限公司解放北路营业部职员,天津津源职员,天津天大管业股份有限公司经理。现任新华基金管理股份有限公司督察长兼任子公司北京新华富时资产管理有限公司董事。

5.投资管理团队成员
主席:总经理张友友先生;成员:副总经理兼投资总监崔建波先生、投资总监助理于泽晖先生、权益投资部总监赵强先生、固定收益与平衡投资部总监魏秋先生、研究部总监张霖女士、金融工程部副总监李忠先生。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。
二、基金托管人
(一)基金托管人概况
名称:招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)
设立日期:1987年4月8日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本:252.20亿元
法定代表人:李健红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]133号
电话:0755-83190084
传真:0755-83191261
资产托管部信息披露负责人:张燕

2.发展概况
招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿美元,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又发行了22亿美元,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日发行人民币股融资,共发行了242亿股。截至2018年9月30日,本集团总资产66,086.81亿元人民币,高级法下资本充足率15.46%,权重法下资本充足率12.80%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2006年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理室、产品管理室、业务运营室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室,现有员工180人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、合格境内机构投资者托管(ODII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金

基金托管业务资格。

招商银行确立“因势而变、先声夺人”的托管理念和“财富信托、守信承诺”的托管核心价值,独创“eS托管银行”品牌体系,以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品;在业内率先推出“网上托管银行系统”,托管业务综合系统和“6e”托管服务标准;首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,成为国内唯一获得该奖项的托管银行;“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;7月荣膺2016年中国资产管理《金贝奖》“最佳托管银行奖”;2017年6月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,“主动线上托管银行20”荣膺《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”,2018年1月获得中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项,同时招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖,以及中央金融工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖;3月招商银行荣获公募基金20年“最佳基金托管银行”奖,5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。

(二)主要人员情况
李建红先生,本行董事长,非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,本行行长,执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京分行行长。

王良先生,本行副行长,货币银行学硕士,高级经济师。1991年至1996年,在中国银行国际信托投资公司工作;1996年6月至2001年10月,历任招商银行北京分行厦路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理;2001年10月至2006年3月,历任北京分行行长助理、副行长;2006年3月至2008年6月,任北京分行党委书记、副行长(主持工作);2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、党委书记;2012年6月至2013年11月,任招商银行总行总行助理兼北京分行行长、党委书记;2013年11月至2014年12月,任招商银行总行总行行长助理;2015年1月起担任本行副行长;2016年11月起兼任本行董事会秘书。

姚然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后任职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管业务从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

(三)基金托管业务经营情况
截至2018年9月30日,招商银行股份有限公司累计托管401只开放式基金。

(四)托管人的内部控制制度

1.内部控制目标
招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念;形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全;建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患,保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时;确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2.内部控制组织结构
招商银行资产托管业务建立三级风险控制防范体系:一级风险防范是在招商银行总行风控管理层面进行预防和控制;

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察室,负责部门内部风险防范和控制;

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时,遵循内控衡制原则,视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

3.内部控制原则

(1)全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节,覆盖所有部门和岗位。

(2)审慎性原则。托管组织体系的构成、内部控制制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点,以有效防范各种风险作为内部控制的核心,体现“内控优先”的要求。

(3)独立性原则。招商银行资产托管部各室、各岗位职责保持相对独立,不同托管资产之间、托管资产与自有资产之间应严格分离。内部控制制度、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

(4)有效性原则。内部控制具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权利,内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

(5)适应性原则。内部控制能适应招商银行托管业务发展的需要,并能随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

(6)防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统,包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

(7)重要性原则。内部控制应在全面控制的基础上,关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8)制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督,同时兼顾运营效率。

4.内部控制措施
(1)完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度,保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2)经营授权控制。招商银行资产托管部制定托项目审批、资金清算与会计核算双授权、大额资金支付授权、凭证管理等一系列完整的操作规程,有效地控制业务运作过程中的风险。

(3)业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施,采用加密、直连方式传输数据,数据执行双备份制度,所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(4)客户资料风险控制。招商银行资产托管部对客户资料进行严格的客户资料的加密和备份措施,采用加密、直连方式传输数据,数据执行双备份制度,所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(5)信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责,网络24小时值守并设置门禁管理、电脑病毒设置及权限管理、业务网络和办公、托管业务网络与全行信息网络物理隔离、与外部业务机构实行防火墙保护,对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等,保证信息技术系统的安全。

(6)人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的人才化和信息化员工培训、激励机制,加强人力资源管理和建立人才梯队队伍及人才储备机制,有效的进行人力资源资源管理。

(五)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定,对基金投资范围、投资比例、投资对象等情事的合规性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金估值和核资核算环节中,基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督,对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行,并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定,及时以书面形式通知基金管理人进行整改,整改的时限应符合法律法规及基金合同约定调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对其与基金托管人核对的书面事项能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1.直销机构
(1)新华基金管理股份有限公司北京直销中心
住所:重庆市江北北区聚贤岩76号力帆中心2号办公楼第19层
办公地址:北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座
法定代表人:陈重
电话:010-61873099
联系人:陈静
网址:www.ncfund.com.cn
客服电话:400-819-8866
(2)电子直销:新华基金网上交易的平台
网址:https://trade.ncfund.com.cn

2.其他销售机构
(1)招商银行股份有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李健红
联系人:邓娟娟
客服电话:95555
网址:www.cmbchina.com
(2)交通银行股份有限公司
住所:上海市银城中路188号
法定代表人:彭纯
联系人:宋佳
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com
(3)东方证券股份有限公司
住所:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
法定代表人:潘禹军
联系人:胡月娟
客服电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn

(4)恒泰证券股份有限公司
住所:内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼

14-18楼
法定代表人:庞介民
联系人:黄莹
客服电话:400-196-6188
网址:www.cntz.com.cn
(5)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号证券大厦
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层
法定代表人:杨华辉
联系人:黄莹
客服电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn

(6)北京肯特瑞基金销售有限公司
住所:北京市海淀区皂君洼19号院1幢4层1座401
法定代表人:江卉
客服电话:个人业务:95118 企业业务:400-088-8816
网址:http://fund.ketread.com
(7)上海好实基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26楼2641号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
联系人:胡凯凯
客服电话:400-700-9665
公司网址:www.howbuy.com

(8)和讯信息科技有限公司
注册地址:上海市朝阳门朝外大街22号1002室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号 芝兰大厦10层
法定代表人:王莉
客服电话:400-920-0022
联系人:刘洋
公司网站:lhc@kehexun.com
(9)上海泰联基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:王之光
联系人:何雪
客服电话:400-821-9031
公司网站:www.tlunion.com

(10)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:王之光
联系人:何雪
客服电话:400-821-9031
公司网站:www.lufunds.com
(11)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市余杭区文一西路969号3幢5层599室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12楼
法定代表人:崔娟娟
客服电话:400-766-123
网址:www.fund123.cn

(12)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市昆明路518号北美广场A1002-A1003室
法定代表人:王翔
联系人:基蕊
客服电话:400-820-5369
公司网站:www.jiyufund.com.cn

(13)深圳众基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资置地大厦10楼1001
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资置地大厦B 楼
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
联系人:董彩芹
公司网站:www.zzfund.com
(14)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人:其实
客服电话:400-1818-188
联系人:丁姗娜
公司网站:www.1234567.com.cn

(15)浙江阿花港基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌雁平
联系人:林海明
客服电话:4008-773-772
公司网站:fund.10jqka.com.cn
(16)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:刘汉青
联系人:王峰
客服电话:95177
公司网站:www.snjfund.com

(17)上海长基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢2203室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路565号景联国际B座16层
法定代表人:李扬
联系人:唐诗洋
客服电话:400-820-8289
公司网站:www.eichfund.com
(18)阳光人寿保险股份有限公司
注册地址:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址:北京市朝阳区东三环北路21号银河国际A座12层
法定代表人:李科
联系人:王磊
客服电话:95610
网址:http://fund.sinosig.com/

基金管理人可以根据需要,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并按照相关规定及时公告。
(二)登记机构
名称:新华基金管理股份有限公司
住所:重庆市江北北区聚贤岩76号力帆中心2号办公楼第19层
办公地址:北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座
法定代表人:陈重
电话:023-63711923
传真:023-63710297
联系人:陈欣悦

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
经办律师:安冬、陆奇
联系人:陆奇
(四)审计基金资产的会计师事务所
名称:瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层
办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔6-11层
法定代表人:杨剑涛
电话:010-88219191
传真:010-88210588
经办注册会计师:张伟、谢恩
联系人:谢恩

四、基金名称
本基金名称:新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型
基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标
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追求基金资产净值的持续、稳定增长,力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。

七、基金的投资范围
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的上市交易的股票(包括中小创、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、公开发行、短期融资券、债券资产、国债、金融债、企业债、中小企业私募债券、可转换公司债券等,资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具,同业存单、现金等,以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将根据适

时程序,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为70%-95%,权证投资占基金资产净值比例为0-3%,每个交易日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易所保证金后,应当保持不低于基金资产净值%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会允许,基金管理人可在履行适当程序后,可调整上述投资品种和投资比例。

八、基金的投资策略

投资策略方面,本基金将遵循下行风险控制 and 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,主要采用趋势跟随策略、定向增发策略、事件驱动策略、大宗交易策略等。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债投资策略,在获取稳定收益的同时,降低基金资产净值整体的波动性。本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作,减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险;同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整,提高投资组合的运作效率。

1.资产配置策略
本基金通过对上市公司盈利增长趋势以及市场价格趋势两个维度的综合考量,将好公司与好股票有机结合,前瞻性地把握市场中存在的具有综合趋势机会的个股,进一步结合对上市公司品质的评价构建最终的投资组合。
2.定向增发策略
本基金的对定向增发策略将综合考虑标的股所处行业发展态势、未来成长空间、募投项目情况以及折溢价率等因素,对定向增发股票进行合理配置。
3.事件驱动策略
本基金的事件驱动策略主要通过通过分析影响上市公司股价波动的突发性事件,把握市场对上市公司定价与实际价值之间的显著差异,对个股进行配置调整和优化,以获取事件发生后向价值与价值之间的回归收益。本基金的事件驱动策略将通过策略研判、公司调研、财报分析、数据收集、数据统计以及数据挖掘等一系列定性与定量的研究方法,对在合理持有周期内可获利的事件进行识别并积极参与。目前主要关注的事件包括资产重组、高管增持、股权激励以及高送转等,后期基金管理人将积极关注股票市场市场发展动态,以实证检验为根基,开发更适应市场环境的事件驱动策略及策略优化方法。

(4)大宗交易策略
本基金的大宗交易策略是通过大宗交易市场折价买入股票,较适当的时间内通过二级市场卖出,赚取大宗交易价格与二级市场价格之间的套利空间。在投资标的的选择方面,基金管理人一方面将重点关注标的股票在大宗交易市场的折价情况以保证获取足够的套利收益;另一方面通过重点关注标的上市公司的未来成长性、市场估值水平以及二级市场成交活跃度等指标,以避免在合理的时间范围减持造成较高的冲击成本,降低获利空间。

3.债券投资策略
(1)久期策略
根据对市场利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益;在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。
(2)收益曲线策略
在长期预期基础上,根据对收益率曲线形状变化的预测,采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。如预期收益率曲线呈平行移动或变平时,将采取哑铃型策略;预期收益率曲线陡峭时,将采取子弹型策略。

(3)信用策略
本基金主要投资信用债券,主要包括:金融债(不含政策性金融债)、企业债券、公司债券、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、中期票据、资产支持证券等除国债和中央银行票据之外的、非国家信用的固定收益类债券。因此,信用策略是本基金固定收益类资产投资策略的重要组成部分。

(4)中小企业私募债券投资策略
本基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。
(5)可转换债券投资策略
1)投资策略
基于基金管理人可转换债券价值评估体系,综合性与定量分析相结合确定可转换债券的投资价值,从中精选发债公司具备良好发展潜力或正股具备较高上涨预期且市场价格处于合理水平的可转换债券进行投资。定性方面,重点分析可转换债券对应正股所处行业、成长性、估值情况等基本面指标;定量方面,重点分析折溢价率、底价溢价率、Delta系数、转股条款等指标。
2)转股策略
根据市场情况的变化灵活确定转股策略,以有效保障或提高基金利益。转股期间,如果在明显有利市场转机会,即本基金所持有的可转换债券的实际转股价格明显低于对应正股的市场价格,将通过转股方式实现获利。如果可转换债券在变现过程中可能出现较大的变现损失,将通过转股方式保障基金资产的流动性。
3)赎回策略
如可转换债券对应正股价格上涨且满足赎回触发条件,将通过转股方式保障已有收益。
4)资产支持证券投资策略
本基金将深入研判资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量,提前偿还率水平等基本面因素,并且结合发债公司市场宏观分析的结果,评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险,辅以量化模型分析,评估其内在价值进行投资。

5.权证投资策略
在控制风险的前提下,本基金将采用以下策略:普通策略:根据权证定价模型,选择低估的权证进行投资。保护策略:利用权证认购,可以实现对正股持仓的保护。套利策略:当认沽权证和正股的价格低于行权价格时,并且总收益率超过市场无风险收益率时,可以进行无风险套利。

6.股指期货投资策略
本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作,减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险;同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整,提高投资组合的运作效率。

九、基金的业绩比较标准
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和中等预期收益品种,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型基金。

十、基金的风险收益特征
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和中等预期收益品种,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型基金。

十一、基金的投资组合报告
基金管理人将根据需要,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并按照相关规定及时公告。
(二)登记机构
名称:新华基金管理股份有限公司
住所:重庆市江北北区聚贤岩76号力帆中心2号办公楼第19层
办公地址:北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座
法定代表人:陈重
电话:023-63711923
传真:023-63710297
联系人:陈欣悦

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
经办律师:安冬、陆奇
联系人:陆奇
(四)审计基金资产的会计师事务所
名称:瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层
办公地址:北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔6-11层
法定代表人:杨剑涛
电话:010-88219191
传真:010-88210588
经办注册会计师:张伟、谢恩
联系人:谢恩

四、基金名称
本基金名称:新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型
基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标
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追求基金资产净值的持续、稳定增长,力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。

七、基金的投资范围
本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的上市交易的股票(包括中小创、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、公开发行、短期融资券、债券资产、国债、金融债、企业债、中小企业私募债券、可转换公司债券等,资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具,同业存单、现金等,以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将根据适

时程序,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为70%-95%,权证投资占基金资产净值比例为0-3%,每个交易日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易所保证金后,应当保持不低于基金资产净值%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会允许,基金管理人可在履行适当程序后,可调整上述投资品种和投资比例。

八、基金的投资策略
投资策略方面,本基金将遵循下行风险控制 and 收益获取,在资产配置策略方面,主要采用趋势跟随策略、定向增发策略、事件驱动策略、大宗交易策略等。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债投资策略,在获取稳定收益的同时,降低基金资产净值整体的波动性。本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作,减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险;同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整,提高投资组合的运作效率。

1.资产配置策略
本基金通过对上市公司盈利增长趋势以及市场价格趋势两个维度的综合考量,将好公司与好股票有机结合,前瞻性地把握市场中存在的具有综合趋势机会的个股,进一步结合对上市公司品质的评价构建最终的投资组合。
2.定向增发策略
本基金的对定向增发策略将综合考虑标的股所处行业发展态势、未来成长空间、募投项目情况以及折溢价率等因素,对定向增发股票进行合理配置。
3.事件驱动策略
本基金的事件驱动策略主要通过通过分析影响上市公司股价波动的突发性事件,把握市场对上市公司定价与实际价值之间的显著差异,对个股进行配置调整和优化,以获取事件发生后向价值与价值之间的回归收益。本基金的事件驱动策略将通过策略研判、公司调研、财报分析、数据收集、数据统计以及数据挖掘等一系列定性与定量的研究方法,对在合理持有周期内可获利的事件进行识别并积极参与。目前主要关注的事件包括资产重组、高管增持、股权激励以及高送转等,后期基金管理人将积极关注股票市场市场发展动态,以实证检验为根基,开发更适应市场环境的事件驱动策略及策略优化方法。

(4)大宗交易策略
本基金的大宗交易策略是通过大宗交易市场折价买入股票,较适当的时间内通过二级市场卖出,赚取大宗交易价格与二级市场价格之间的套利空间。在投资标的的选择方面,