

# 华融新利灵活配置混合型证券投资基金

## 2019年第一季度报告

分析报告;另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

综上所述,本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
 本报告期内,本基金未发现在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的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交易量均超过该证券当日成交量的%

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析  
 2019年一季度在中美贸易摩擦和社融与信贷数据改善,政策与基建托底、国内外代表性质量助力下,市场信心增强,整体估值快速修复,尤其以蓝筹白马、成长等业绩优秀个股为代表,市场风格表现尚佳。报告期内,重要会议的召开与制度的设立提升了金融市场的地位,明确了下一阶段的工作安排,其中包括中央政治局和十三次会议的金融供给侧结构性改革;科创板的制度设计落地执行;政府工作报告的底线思维和三次会议的金融供给侧结构性改革;减税降费、深化改革,注重“硬科技”。在政策的驱动下,结构性特征显现,预计一季度经济不会失速下滑,等待数据的确认。

本报告期内积极参与市场,精准布局高端制造业、信息技术产业、生物医药、消费结构升级等重点板块,精选行业龙头,有心提高个股个股,增强操作灵活性,对市场新增的热点板块(边缘计算、氢能电动车、芯在电力物联网、高新材料)及创新驱动进行深入研究,加大储备。

4.5 报告期内基金的投资表现和净值变动情况  
 截至本报告期末本基金份额净值为0.910元;本报告期内基金份额净值增长率为24.4%,业绩比较基准收益率为30%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明  
 报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人的情形。报告期内,本基金自2017年9月6日起存在基金资产净值低于五千万元的情况。公司正在拟定相关应对方案。

5 投资组合报告  
 5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合  
 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

5.4 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债券投资明细  
 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十名资产支持证券投资明细

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五名股指期货投资明细  
 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权证投资明细

5.8 报告期末本基金投资的国债期货投资情况  
 5.9 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明  
 5.10 报告期末本基金投资的期权投资情况说明  
 5.11 报告期末本基金投资的贵金属投资情况

5.12 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.13 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.14 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.15 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.16 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.17 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.18 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.19 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.20 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.21 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.22 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.23 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.24 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.25 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.26 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.27 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.28 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.29 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.30 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.31 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.32 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.33 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.34 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.35 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.36 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.37 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.38 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.39 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.40 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.41 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.42 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.43 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.44 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.45 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.46 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.47 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.48 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.49 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.50 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.51 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.52 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.53 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.54 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.55 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.56 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.57 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.58 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.59 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.60 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.61 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.62 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.63 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.64 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.65 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.66 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.67 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.68 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.69 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.70 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.71 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.72 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.73 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.74 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.75 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.76 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.77 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.78 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.79 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.80 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.81 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.82 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.83 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.84 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.85 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.86 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.87 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.88 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.89 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.90 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.91 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.92 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.93 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.94 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.95 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.96 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.97 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.98 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.99 报告期末按品种分类的债券投资组合  
 5.100 报告期末按品种分类的债券投资组合

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	-	-
C	制造业	4,300,721.40	48.18
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	310,280.00	3.48
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	227,700.00	2.55
I	信息传输、软件和信息技术服务业	169,750.00	1.91
J	金融业	798,200.00	8.81
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	360,400.00	3.93
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	331,500.00	3.71
R	文化、体育和娱乐业	298,320.00	3.31
S	综合	-	-
合计		6,021,881.40	76.43

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1000238	浦发债01	30,000	396,500.00	3.96
2	4010198	中国国债01	5,000	390,400.00	3.90
3	200003	国债07	12,700	336,650.00	3.37
4	300047	华泰债01	5,000	331,500.00	3.31
5	020560	三花债01	21,200	329,070.00	3.29
6	600038	中债01	7,000	327,260.00	3.27
7	002271	北方债01	4,500	317,260.00	3.18
8	601607	上海药01	16,000	316,200.00	3.16
9	300122	智飞债01	6,000	306,690.00	3.07
10	600019	中烟债01	5,000	301,400.00	3.01

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1000238	浦发债01	30,000	396,500.00	3.96
2	4010198	中国国债01	5,000	390,400.00	3.90
3	200003	国债07	12,700	336,650.00	3.37
4	300047	华泰债01	5,000	331,500.00	3.31
5	020560	三花债01	21,200	329,070.00	3.29
6	600038	中债01	7,000	327,260.00	3.27
7	002271	北方债01	4,500	317,260.00	3.18
8	601607	上海药01	16,000	316,200.00	3.16
9	300122	智飞债01	6,000	306,690.00	3.07
10	600019	中烟债01	5,000	301,400.00	3.01

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1000238	浦发债01	30,000	396,500.00	3.96
2	4010198	中国国债01	5,000	390,400.00	3.90
3	200003	国债07	12,700	336,650.00	3.37
4	300047	华泰债01	5,000	331,500.00	3.31
5	020560	三花债01	21,200	329,070.00	3.29
6	600038	中债01	7,000	327,260.00	3.27
7	002271	北方债01	4,500	317,260.00	3.18
8	601607	上海药01	16,000	316,200.00	3.16
9	300122	智飞债01	6,000	306,690.00	3.07
10	600019	中烟债01	5,000	301,400.00	3.01

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1000238	浦发债01	30,000	396,500.00	3.96
2	4010198	中国国债01	5,000	390,400.00	3.90
3	200003	国债07	12,700	336,650.00	3.37
4	300047	华泰债01	5,000	331,500.00	3.31
5	020560	三花债01	21,200	329,070.00	3.29
6	600038	中债01	7,000	327,260.00	3.27
7	002271	北方债01	4,500	317,260.00	3.18
8	601607	上海药01	16,000	316,200.00	3.16
9	300122	智飞债01	6,000	306,690.00	3.07
10	600019	中烟债01	5,000	301,400.00	3.01

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1000238	浦发债01	30,000	396,500.00	3.96
2	4010198	中国国债01	5,000	390,400.00	3.90
3	200003	国债07	12,700	336,650.00	3.37
4	300047	华泰债01	5,000	331,500.00	3.31
5	020560	三花债01	21,200	329,070.00	3.29
6	600038	中债01	7,000	327,260.00	3.27
7	002271	北方债01	4,500	317,260.00	3.18
8	601607	上海药01	16,000	316,200.00	3.16
9	300122	智飞债01	6,000	306,690.00	3.07
10	600019	中烟债01	5,000	301,400.00	3.01

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1000238	浦发债01	30,000	396,500.00	3.96
2	4010198	中国国债01	5,000	390,400.00	3.90
3	200003	国债07	12,700	336,650.00	3.37
4	300047	华泰债01	5,000	331,500.00	3.31
5	020560	三花债01	21,200	329,070.00	3.29
6	600038	中债01	7,000	327,260.00	3.27
7	002271	北方债01	4,500	317,260.00	3.18
8	601607	上海药01	16,000	316,200.00	3.16
9	300122	智飞债01	6,000	306,690.00	3.07
10	600019	中烟债01	5,000	301,400.00	3.01

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1000238	浦发债01	30,000	396,500.00	3.96
2	4010198	中国国债01	5,000	390,400.00	3.90
3	200003	国债07	12,700	336,650.00	3.37
4	300047	华泰债01	5,000	331,500.00	3.31
5	020560	三花债01	21,200	329,070.00	3.29
6	600038	中债01	7,000	327,260.00	3.27
7	002271	北方债01	4,500	317,260.00	3.18
8	601607	上海药01	16,000	316,200.00	3.16
9	300122	智飞债01	6,000	306,690.00	3.07
10	600019	中烟债01	5,000	301,400.00	3.01

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1000238	浦发债01	30,000	396,500.00	3.96
2	4010198	中国国债01	5,000	390,400.00	3.90
3	200003	国债07	12,700	336,650.00	3.37
4	300047	华泰债01	5,000	331,500.00	3.31
5	020560	三花债01	21,200	329,070.00	3.29
6	600038	中债01	7,000	327,260.00	3.27
7	002271	北方债01	4,500	317,260.00	3.18
8	601607	上海药01	16,000	316,200.00	3.16
9	300122	智飞债01	6,000	306,690.00	3.07
10	600019	中烟债01	5,000	301,400.00	3.01

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1000238	浦发债01	30,000	396,500.00	3.96
2	4010198	中国国债01	5,000	390,400.00	3.90
3	200003	国债07	12,700	336,650	