新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金

【2016】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:平安银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一七年一月二十日

§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2017年1月19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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华鑫益灵活配置混合
基金主代码	000584
交易代码	000584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月16日
报告期末基金份额总额	141,128,802.54份
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,力争为投资人提供长期稳定的绝对回报。
投资策略	投资策略的选择,本基金将兼顾下行风险控制和收益获取。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,把握趋势跟随及绝对收益两个核心,趋势跟随策略以期在某行业或个股出现趋势性机会时,积极跟随其市场表现;绝对收益策略以类折利策略为目标,以期获取稳定的绝对回报。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换债券投资策略,在获取稳定收益的同时,降低基金资产净值整体的波动性。
业绩比较基准	年化收益率10%
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市场基金。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
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(2016年10月1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	7,993,996.98
2.本期利润	6,491,116.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0450
4.期末基金资产净值	241,566,772.96
5.期末基金份额净值	1.712

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

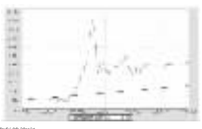
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.64%	0.47%	2.52%	0.00%	0.12%	0.47%

3.2.2自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

新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年4月16日至2016年12月31日)



注:报告期内本基金的各项资产配置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		
崔建波	本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监,权益投资部总监,新华优选消费混合型证券投资基金基金经理,新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理,新华策略精选股票型证券投资基金基金经理,新华优选分红混合型证券投资基金基金经理,新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理,新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2014-12-01	-	22	经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员,中银万国天津券楼营业部投资经纪顾问部经理,海融资讯系统有限公司研究员,和讯信息科技有限公司证券研究部,理财服务部经理,北方国际信托股份有限公司投资部部长高级投资经理。现任新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监、权益投资部总监,新华优选消费混合型证券投资基金基金经理,新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理,新华鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理,新华策略精选股票型证券投资基金基金经理,新华优选分红混合型证券投资基金基金经理,新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理,新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
李会忠	本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监,新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华灵活主题混合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,新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫锐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。	2014-07-18	-	10	经济学硕士,10年证券从业经验。2007年9月加入新华基金管理股份有限公司,历任新华基金管理股份有限公司行业研究员、策略分析师。新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监,新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华灵活主题混合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,新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫锐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。

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,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,同时包括投权、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。

境内交易,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于方的交易,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会议,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、或交确认,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或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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度,市场横盘整理,各行业表现分化严重,建筑、石化、钢铁、纺织服装、商业零售表现较好,其中有国企改革预期的个股表现更为服丽,而计算机、传媒、餐饮旅游、电子、房地产走势较差。本基金在维持适度仓位的基础上适度仓位调整、波段操作,同时优选个股,取得了较好的投资收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为1.712元,本报告期份额净值增长率为2.64%,同期比较基准的增长率为2.52%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年一季度,我们认为市场将以震荡格局为主,难有趋势性行情。我们将优选那些质地好、有业绩、估值低、安全边际较高的股票进行配置。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	147,859,741.20	60.17
	其中:股票	147,859,741.20	60.17
2	固定收益投资	696,068.61	0.28
	其中:债券	696,068.61	0.28
	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	96,468,386.45	39.25
7	其他各项资产	712,642.03	0.29
8	合计	245,735,838.29	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,306,400.00	0.54
B	采矿业	1,794,546.93	0.74
C	制造业	109,624,080.33	45.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	425,756.66	0.18
E	建筑业	6,291,018.99	2.60
F	批发和零售业	5,923,453.02	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	4,997,119.20	2.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,568,246.85	2.31
J	金融业	1,303,845.81	0.54
K	房地产业	6,330,250.00	2.62
L	租赁和商务服务业	142,743.90	0.06
M	科学研究和技术服务业	1,328,968.18	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	2,465,895.00	1.02
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	367,438.06	0.15
S	综合	-	-
	合计	147,859,741.20	61.21

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	600963	岳阳林纸	800,900	6,543,353.00	2.71
2	300123	太阳鸟	380,416	6,101,872.64	2.53
3	000100	TCL集团	1,450,000	4,795,000.00	1.98
4	601689	拓普集团	150,995	4,442,272.90	1.84
5	000018	神州长城	405,100	4,334,570.00	1.79
6	002536	西泵股份	250,400	3,535,648.00	1.46
7	600768	宁波富邦	120,000	2,930,400.00	1.21
8	600004	白云机场	200,000	2,818,000.00	1.17
9	601678	滨化股份	380,000	2,770,200.00	1.15
10	000948	南天信息	150,000	2,655,000.00	1.10

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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	696,068.61	0.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	696,068.61	0.29

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

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	128011	汽模转债	5,400	696,068.61	0.29

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

本报告期末本基金无国债期货投资。

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。

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	381,510.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,273.79
5	应收申购款	308,858.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	712,642.63

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128011	汽模转债	696,068.61	0.29

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	300123	太阳鸟	6,101,872.64	2.53	重大事项停牌
2	600768	宁波富邦	2,930,400.00	1.21	重大事项停牌

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	151,816,866.82
报告期基金总申购份额	4,724,538.43
减:报告期基金总赎回份额	15,412,602.71
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	141,128,802.54

§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

本基金管理人于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一路财富灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金合同》

(五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(六)更新的《新华鑫益灵活配置混合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。

新华基金管理股份有限公司

二〇一七年一月二十日

新华鑫锐混合型证券投资基金

【2016】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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一七年一月二十日

§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2017年1月18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2016年10月26日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华鑫锐混合
基金主代码	001622
交易代码	001622
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月26日
报告期末基金份额总额	294,211,642.40份
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,力争为投资人提供长期稳定的绝对回报。
投资策略	投资策略方面,本基金将以大类资产配置策略为基础,采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。本基金将采用战略性和战术性相结合的大类资产配置策略。在基金合同规定的投资比例范围内确定各大类资产的配置比例。股票投资策略采用定性分析与定量分析相结合的方法,精选具有竞争优势和增长潜力、估值合理的上市公司股票进行投资,构建股票组合。债券投资策略主要运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略、可转换债券投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
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市场基金。
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(2016年10月26日(基金合同生效日)-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	2,413,712.39
2.本期利润	1,465,965.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0060
4.期末基金资产净值	296,754,844.26
5.期末基金份额净值	1.0052

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.本基金合同生效日为2016年10月26日,至2016年12月31日按离日未满一年。

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

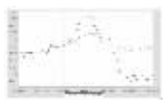
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.52%	0.20%	-2.19%	0.46%	2.71%	-0.26%

3.2.2自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

新华鑫锐混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年10月26日至2016年12月31日)



注:1.本基金自2016年10月26日成立,截至报告期末基金合同生效未满一年。

2.本基金的建仓期为六个月,截至报告期末基金尚未完成建仓。

§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		
李会忠	本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监,新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华灵活主题混合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,新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫动力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。	2016-10-26	-	10	经济学硕士,10年证券从业经验。2007年9月加入新华基金管理股份有限公司,历任新华基金管理股份有限公司行业研究员、策略分析师。新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监,新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华灵活主题混合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,新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫动力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。
张永超	本基金基金经理,新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理,新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016-11-23	-	7	工商管理硕士,7年证券从业经验。历任中信证券投份有限公司量化投资经理、北京乐正资本管理有限公司高级投资经理、中融国际信托有限公司投资经理。2016年1月加入新华基金管理股份有限公司,现任新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫锐混合型证券投资基金基金经理、新华鑫弘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,新华基金管理股份有限公司作为新华鑫锐混合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》、《新华鑫锐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。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,同时包括投权、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。

境内交易,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于方的交易,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会议,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、或交确认,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或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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度,市场横盘整理,各行业表现分化严重,建筑、石化、钢铁、纺织服装、商业零售表现较好,其中有国企改革预期的个股表现更为服丽,而计算机、传媒、餐饮旅游、电子、房地产走势较差。本基金在维持较高仓位的基础上适度仓位调整、波段操作,同时优选个股,取得了较好的投资收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为1.0052元,本报告期份额净值增长率为0.52%,同期比较基准的增长率为-2.19%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年一季度,我们认为市场将以震荡格局为主,难有趋势性行情。我们将优选那些质地好、有业绩、估值低、安全边际较高的股票进行配置。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	101,021,111.26	33.87
	其中:股票	101,021,111.26	33.87
2	固定收益投资	119,496,000.00	40.07
	其中:债券	119,496,000.00	40.07
	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	69,700,304.56	23.37
	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	6,143,907.53	2.06
7	其他各项资产	1,858,609.60	0.62
8	合计	298,219,932.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,818,278.00	2.31
B	采矿业	-	-
C	制造业	46,325,080.61	15.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,909,176.00	1.32
E	建筑业	3,980,777.23	1.35
F	批发和零售业	7,734,318.52	2.62
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,506,474.00	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,144,032.90	3.43
J	金融业	18,443,674.00	6.24
K	房地产业	-	-
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	2,159,400.00	0.73
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	101,021,111.26	34.16

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	300887	圣银高科	248,600	3,288,978.00	1.11
2	600519	贵州茅台	9,700	3,241,256.00	1.10
3	601328	交通银行	542,700	3,131,379.00	1.06
4	002024	苏宁云商	273,100	3,126,996.00	1.06
5	300498	温氏股份	88,000	3,099,360.00	1.05
6	601318	中国平安	87,400	3,096,582.00	1.05
7	000001	平安银行	335,900	3,056,690.00	1.03
8	600000	浦发银行	187,500	3,039,375.00	1.03
9	600036	招生银行	333,000	3,023,640.00	1.02
10	601166	兴业银行	185,200	2,989,128.00	1.01

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	19,938,000.00	6.74
	其中:政策性金融债	19,938,000.00	6.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	69,868,000.00	23.62
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	29,690,000.00	10.04
9	其他	-	-
10	合计	119,496,000.00	40.40

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

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	011699039	16国联交建03CP001	100,000	10,000,000.00	3.38
2	011698980	16物产中大03CP007	100,000	10,002,000.00	3.38
3	011698893	16龙源电力03CP016	100,000	9,997,000.00	3.38
4	160211	16国开11	100,000	9,983,000.00	3.38
5	011698986	16华侨城03CP006	100,000	9,983,000.00	3.38

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

本报告期末本基金无权证投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金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

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金合同尚无国债期货投资政策。

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	15,240.51
2	应收证券清算款	1,111,044.10
3	应收股利	-
4	应收利息	732,324.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,858,609.60

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

本报告期末本基金前十名股票不存在流通受限的情况。

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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	288,601,942.89
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	76,849,271.49
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	68,239,571.98
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	294,211,642.40

§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

本基金管理人无持有本基金份额情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金报告期末无发起式基金发起资金持有份额情况。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末有影响投资者决策的其他重要信息。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

(一)中国证监会核准新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)更新的《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(五)关于申请募集新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

(八)中国证监会要求的其他文件

(九)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人