新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

【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1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华纯债添利债券发起
基金主代码	519152
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2012年12月21日
报告期末基金份额总额	471,017,986.90份
投资目标	本基金通过对债券组合的久期、期限结构、类属品种以及单个债券进行积极主动的配置，力争在严格控制投资组合风险的同时，提高基金资产的流行性及收益率水平，为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	基金的投资策略主要包括：利率预期策略、类属品种配置策略以及证券选择策略。采用定量与定性相结合的研究方法，深入分析市场利率发展方向、期限结构变化趋势、信用主体评级水平以及单个债券的投资价值，积极主动进行类属品种配置及个券选择，谋求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。
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

下属分级基金的基金简称	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
下属分级基金的交易代码	519152	519153
报告期末下属分级基金的份额总额	430,399,421.16份	40,618,565.74份

§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）	
	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
1.本期已实现收益	5,796,847.28	743,804.44
2.本期利润	3,641,040.38	418,142.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0071
4.期末基金资产净值	571,256,715.54	53,093,066.61
5.期末基金份额净值	1.327	1.307

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。

3.2 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

1.新华纯债添利债券发起A类：

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	0.61%	0.05%	-2.33%	0.15%	2.94%	-0.10%

2.新华纯债添利债券发起C类：

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	0.54%	0.05%	-2.33%	0.15%	2.87%	-0.10%

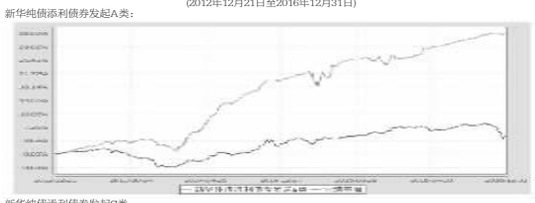
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华纯债添利债券型发起式证券投资基金

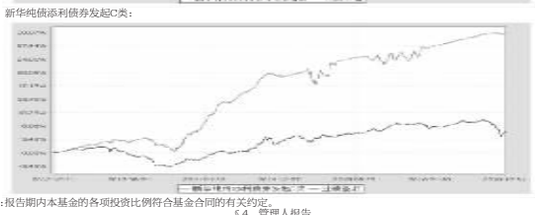
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2012年12月21日至2016年12月31日）

1. 新华纯债添利债券发起A类：



2. 新华纯债添利债券发起C类：



注：报告期内本基金的各项投资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		
于泽雨	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司投资总监助理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理、新华信用增强债券型证券投资基金基金经理、新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理。	2012-12-21	-	9	经济学博士，9年证券从业经验。历任华安财产保险公司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理，于2012年10月加入新华基金管理股份有限公司投资总监助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华信用增强债券型证券投资基金基金经理、新华双利债券型证券投资基金基金经理、新华恒稳添利债券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纯债添利债券型发起式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》、《新华基金法》、《新华纯债添利债券型发起式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，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动公平交易的各个环节。

场内交易，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手方的交易，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、成交确认，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成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，宏观经济方面，工业企业利润增速提高，带动经济基本面短期企稳；CPI受到季节影响，温和抬升；PPI由负转正，显示工业品价格在供给侧调控影响下有所回暖；货币政策受海外因素制约，稳中偏紧。利率债市场上，收益率大幅上行，短端涨幅约100bp，长端的10年期国债上涨45bp至3.17%，10年期国开债上涨65bp至3.75%，期限利差被动压缩。信用债市场上，资金面冲击带动信用利差小幅反弹，流动性好的中高评级信用债调整明显。基金操作方面，考虑到四季度长端收益率水平吸引力有限，本基金主要在短期品种中寻找投资机会，重点关注资质资金百分之百控股、负债率相对适中、有一定竞争力的地方国有企业发行的债券，投资组合维持较低的杠杆比例和久期，同时注意保持组合的流动性和收益的稳定性。

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A类份额净值为1.327元，本报告期份额净值增长率为0.61%，同期比较基准的增长率为-2.33%；本基金C类份额净值为1.307元，本报告期份额净值增长率为0.54%，同期比较基准的增长率为-2.33%。

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，人民币经过较大幅度的贬值之后，之前高估的汇率环境得到很大的改善，这可能对出口、经济增长和通胀都会有一定的刺激作用。外储利率环境从超低的状态向均值水平有所回归也会对国内利率水平有一定的带动作用。金融监管将持续发力，使得负债端成本逐渐增加，利率底部有抬升倾向；而另一方面，经济基本面总体依然偏弱，财政政策方向积极，但空间受限，货币政策保持中性稳健，这些将对债市形成主要支撑，总体来看，收益率大概率可能呈现区间震荡走势，债券投资方面，考虑到一年期大右信用债的吸引力逐渐显现，本基金将在一季度重点关注该期限信用债的配置机会，合理控制杠杆，在保证组合流动性的同时提高收益。重点关注省国资委百分之百控股、负债率相对适中、有一定竞争力的国有企业与行业龙头企业发行的债券。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期末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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	645,825,048.52	84.52
	其中：债券	645,825,048.52	84.52
	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	5,326,654.36	0.70
7	其他各项资产	112,954,593.43	14.78
8	合计	764,106,296.30	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	29,955,000.00	4.80
	其中：政策性金融债	29,955,000.00	4.80
4	企业债券	142,340,048.52	22.80
5	企业短期融资券	433,082,000.00	69.37
6	中期票据	40,448,000.00	6.48
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	645,825,048.52	103.44

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	041651014	16西矿股CP001	400,000	40,228,000.00	6.44
2	011698117	16津航空SCP001	400,000	39,944,000.00	6.40
3	011699550	16晋交投SCP001	320,000	32,160,000.00	5.15
4	041667002	16西安民生CP001	300,000	30,264,000.00	4.85
5	011699604	16晋交投SCP002	300,000	30,195,000.00	4.84

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

本报告期末本基金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

报告期末，本基金未投资贵金属。

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

本基金合同约定本基金不能投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同约定本基金不能投资股指期货。

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

本基金合同尚无国债期货投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金合同约定本基金不能投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金合同约定本基金不能投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名债券的发行主体没有出现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本报告期内，本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,839,279.41
5	应收申购款	100,115,314.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	112,954,593.43

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金无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

本基金合同约定本基金不能投资股票。

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

项目	新华纯债添利债券发起A类	新华纯债添利债券发起C类
本报告期期初基金份额总额	429,232,240.96	65,344,051.52
报告期基金总申购份额	95,377,587.02	16,951,663.39
减：报告期基金总赎回份额	94,210,406.82	41,677,149.17
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	430,399,421.16	40,618,565.74

§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

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内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

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,900.00	2.12%	9,999,900.00	2.12%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,999,900.00	2.12%	9,999,900.00	2.12%	3年

§9 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。

§10 备查文件目录

10.1备查文件目录

（一）中国证监会批准新华纯债添利债券型发起式证券投资基金募集的文件

（二）关于申请募集新华纯债添利债券型发起式证券投资基金之法律意见书

（三）《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金托管协议》

（四）《新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金合同》

（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《新华纯债添利债券型发起式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

（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、基金托管人住所。

10.3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

新华泛资源优势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：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1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华泛资源优势混合
基金主代码	519091
交易代码	519091
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2009年7月13日
报告期末基金份额总额	97,359,865.61份
投资目标	在有效控制风险的前提下，通过重点精选与集中配置具有社会资源和自然资源（泛资源）优势的股票，实现基金净值增长，以求持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采用“自下而上”结合“自上而下”的投资策略，通过股票选择、行业配置，结合自上而下的战术性大类资产配置策略，进行积极投资管理。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+40%×上证国债指数
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高等风险品种，预期风险和收益高于债券型、货币型基金，低于股票型基金。
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1日-2016年12月31日）
1.本期已实现收益	17,220,466.80
2.本期利润	20,202,256.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.2096
4.期末基金资产净值	219,479,937.78
5.期末基金份额净值	2.254

注：1.本期已实现收益指本期利息收入、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。

3.2 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

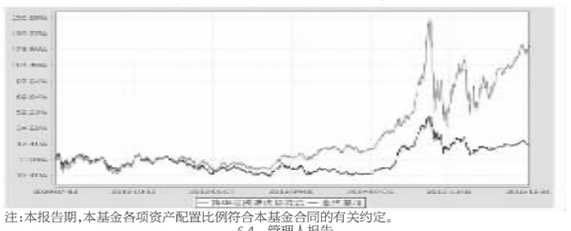
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.49%	0.69%	1.09%	0.43%	9.40%	0.26%

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

新华泛资源优势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

（2009年7月13日至2016年12月31日）



注：本报告期，本基金各项资产配置比例符合本基合同的有关约定。

§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		
栾江伟	本基金基金经理，新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华策略精选股票型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。	2015-08-03	-	8	硕士研究生，8年证券从业经验。2008年7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研究部行业分析师、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华策略精选股票型证券投资基金基金经理、新华泛资源优势灵活配置混合型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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，新华基金管理股份有限公司作为新华泛资源优势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》、《新华基金法》、《新华泛资源优势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。

场内交易，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手方的交易，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、成交确认，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成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，地产调控政策方向逐渐明晰，大宗商品价格波动剧烈，工业增速与通胀指标处于良性水平，汇率波动较大，货币政策边际收紧，使得四季度资金面对股市和债市均构成一定程度冲击。股票方面，我们在市场震荡过程中，我们逢低适当增配了一些业绩优良且可持续性强或资产质量好的标的；债券方面，我们依然维持短久期高评级组合，这也使得我们在12月债市调整中受到的损失较少；转债方面，由于优质标的依然稀缺，我们依然没有参与二级市场投资。

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A类份额净值为1.0021元，本报告期份额净值增长率为0.21%，同期比较基准的增长率为-2.53%；本基金C类份额净值为1.0014元，本报告期份额净值增长率为0.14%，同期比较基准的增长率为-2.53%。

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，经济增速有望维持在当前水平，通胀中枢水平较2016年有抬高但不至于引发过多政策担忧，金融降杠杆有可能会是今后一段时间的监管主基调。

2017年，来自海外的不确定因素较多，比较重要的有：美国新总统能否通过基建、降税等手段提高美国经济增速；欧洲民粹主义会不会使欧盟局势进一步动荡；以原油为代表的大宗商品价格会不会推升全球通胀。对于这些问题，目前很难给出确定的方向性答案，为此，我们会密切跟踪海外政治与经济态势，并评估对国内经济与金融环境的影响。

股票方面：（1）定期市场对基建投资带来的相关投资机会具有较高热情，对此我们认为应保持适度谨慎。基建投资的可持续性并不强，边际回报率在降低，因此未来几年的业绩具有较强的确定性，但随后对业绩的预期也很难乐观。稳定的股票投资应着眼于可持续业绩而不是几年的业绩。（2）与农食住行和医疗相关的传统行业，以及代表未来经济发展方向的蓝海领域，虽然鱼龙混杂，但仍值得多用时间与精力去发掘潜力标的。一方面，经历了2015年下半年和2016年的股市调整，一些好的标的估值已进入合理区间，成长性也经历的时间的检验；另一方面，投资者群体中，基本面派开始占优，这也给价值成长型标的的脱颖而出提供了机会。展望未来一段时间，概念与主题炒作难以再现2015年的情景，而对旧经济的重新追捧也难以再现2016年的情景。因此，我们会立足于宏观经济与微观主体的基本面，选择质地优良、估值合理的标的进行配置。

债券方面，宏观环境的影响多空交织，短期内，工业增速、基建投资与通胀等指标略偏利空，叠加金融降杠杆政策，对于长久期利率债，我们仍不倾向于大比例配置。但是，随着中短期收益率的抬升，中短债的票息保护能力在增强，这给防御型资金提供了较好的配置机会。

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	171,288,039.55	76.11
	其中：股票	171,288,039.55	76.11
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	32,949,704.45	14.64
7	其他各项资产	20,809,539.33	9.25
8	合计	225,047,283.33	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

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	6,747,000.00	3.07
C	制造业	87,861,126.54	40.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.02
E	建筑业	15,592.23	0.01
F	批发和零售业	532,500.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,664,861.88	22.17
J	金融业	106,780.00	0.05
K	房地产业	25,207,842.56	11.49
L	租赁和商务服务业	2,104,960.00	0.96
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	171,288,039.55	78.04

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	600240	华业资本	1,559,200	16,745,808.00	7.63
2	300137	先河环保	1,059,383	15,466,991.80	7.05
3	600760	*ST黑豹	577,604	11,136,205.12	5.07
4	300339	润和软件	352,800	10,795,680.00	4.92
5	000540	中天城投	1,358,272	8,462,034.56	3.86
6	002368	太极股份	250,000	7,652,500.00	3.49
7	000948	南天信息	418,700	7,410,990.00	3.38
8	000968	*ST煤气	650,000	6,747,000.00	3.07
9	000733	振华科技	308,653	5,509,456.05	2.51
10	300377	赢时胜	140,121	5,230,716.93	2.38

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本报告期末本基金无贵金属投资。

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

本基金本报告期末无投资股指期货投资。

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

本基金合同尚无国债期货投资政策。

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投资。

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	211,137.56
2	应收证券清算款	20,590,472.52
3	应收股利	-
4	应收利息	7,929.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,809,539.33

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

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	000540	中天城投	8,462,034.56	3.86	重大资产重组

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

本报告期期初基金份额总额	94,694,051.87
报告期基金总申购份额	9,774,812.49
减：报告期基金总赎回份额	7,108,998.75
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	97,359,865.61

§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末未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期末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

本基金本报告期末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)中国证监会批准新世纪泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新世纪泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(三)中国证监会关于核准新世纪基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

(四)《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(五)《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(六)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(七)更新的《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(八)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(九)基金托管人业务资格批件及营业执照

(十)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

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

新华丰利债券型证券投资基金

【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	新华丰利债券
基金主代码	003221
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	941,628,567.76份
投资目标	本基金在严格控制投资风险并保持较高资产流动性的前提下，通过配置债券等固定收益类金融工具，追求基金资产的长期稳定增值，通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。 首先，本基金管理人将采用战略性与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，在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定的绝对收益。另外，本基金通过自下而上的个股精选策略，精选具有持续成长且估值相对合理的股票构建权益类资产投资组合，增加基金的获利能力，以提高整体的收益水平。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本