新华壹诺宝货币市场基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华壹诺宝货币	
基金主代码	000434	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月3日	
报告期末基金份额总额	8,419,139,721.73份	
投资目标	在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上,追求稳定的当期收益。	
投资策略	本基金采取以长期利率趋势分析为基础,结合短中期经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券类属配置和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资组合管理。	
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券基金,也低于混合型基金与股票型基金。	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新华壹诺宝	新华壹诺宝B
下属分级基金的交易代码	000434	003267
报告期末下属分级基金的份额总额	409,533,745.72份	8,009,605,976.01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(2017年1月1日-2017年3月31日)	
	新华壹诺宝	新华壹诺宝B
1.本期已实现收益	4,694,483.30	92,040,555.69
2.本期利润	4,694,483.30	92,040,555.69
3.期末基金资产净值	409,533,745.72	8,009,605,976.01

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、新华壹诺宝:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9055%	0.0059%	0.3334%	0.0000%	0.5721%	0.0059%

2、新华壹诺宝B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9658%	0.0059%	0.3334%	0.0000%	0.6324%	0.0059%

注:1.本基金利润分配是按日结转份额。

2.本基金本报告期于2016年10月24日分为A类(基金代码:000434)、B类(基金代码:003267)。

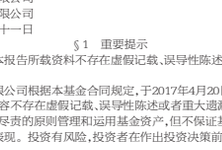
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华壹诺宝货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年12月3日至2017年3月31日)

1、 新华壹诺宝



2、 新华壹诺宝B

注:1.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。

2.本基金本报告期于2016年10月24日分为A类(基金代码:000434)、B类(基金代码:003267)。

§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		
马英	本基金基金经理,新华活期添利货币市场基金基金经理,新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理,新华丰盈回报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。	2015-07-10	-	9	金融学硕士,9年证券从业经验。历任第一创业证券有限责任公司固定收益部业务董事、第一创业摩根大通证券有限责任公司投资银行部副总经理。2012年11月加入新华基金管理股份有限公司,历任固定收益部债券研究员、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、现任新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华丰盈回报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。

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壹诺宝货币市场基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华壹诺宝货币市场基金基金合同》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、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

2017年一季度,短期经济平稳运行。基建继续发力,相关投资维持高位,托底经济增长。供给侧改革推进,工业企业库存水平降至历史低位,工业企业利润维持较高增速。债券市场呈现窄幅震荡走势,资金面波动明显加大,一是由于经济基本面呈现出持续改善趋势,二是美国经济持续走强致使美联储持续加息预期增强,三是央行金融去杠杆防风险政策思路明确。

本报告期内,本基金规模大幅波动,本基金依然秉持稳健投资原则谨慎操作,以确保组合安全性为首要任务,保障组合充足流动性,同时根据规模及配置时点合理调整各类资产配置比例,在提供充分流动性保证的情况下为持有人获取了较好的投资回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内A级(000434)基金份额净值收益率为0.9055%,同期业绩比较基准收益率为0.3334%,B级(003267)基金份额净值收益率为0.9658%,同期业绩比较基准收益率为0.3334%;

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,我们认为经济受益于传统周期行业盈利持续改善有望继续回升。同时由于大宗商品价格制约,叠加监管去杠杆政策取向,货币政策预计维持中性格局。总体来看,债券市场在经历大幅上行后风险调整后收益相对提高,但受内外部基本面及政策面制约,预计短期趋势下行概率不大。同时美国加息预期带来的汇率压力以及去杠杆的推进可能使得资金面波动加大。

本基金在投资策略上将结合市场表现与流动性要求,采取较为灵活的策略应对收益率变化,重点把握资金面波动时点,投向存款、存单、回购和短融等,在提供充分的流动性保证的情况下为持有人获取更好的投资回报。

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	固定收益投资	5,459,045,159.69	62.43
	其中:债券	5,459,045,159.69	62.43
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,159,982,579.33	13.27
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,098,456,929.96	24.00
4	其他资产	26,807,670.08	0.31
5	合计	8,744,292,339.06	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.89	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	319,999,320.00	3.80
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	73
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	78
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	20

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	19.75	3.80
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	0.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	65.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	13.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	4.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.54	3.80

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内本基金未出现投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明。

5.5 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	99,393,826.17	1.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	329,928,033.23	3.92
	其中:政策性金融债	329,928,033.23	3.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	249,901,729.83	2.97
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,779,821,570.46	56.77
8	其他	-	-
9	合计	5,459,045,159.69	64.84
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160414	16农发14	2,800,000.00	279,805,023.27	3.32
2	111793059	17石狮农商银行CD012	2,000,000.00	199,880,858.91	2.37
3	111694641	16西安银行CD028	2,000,000.00	198,193,773.54	2.35
4	111694485	16包商银行CD033	2,000,000.00	198,148,545.37	2.35
5	111794958	17慈溪农商银行CD002	2,000,000.00	197,756,980.61	2.35
6	111694285	16广州农村商业银行CD088	1,500,000.00	148,666,492.89	1.77
7	111694654	16重庆银行CD026	1,500,000.00	148,635,526.12	1.77
8	111694691	16长沙银行CD072	1,500,000.00	148,543,525.90	1.76
9	111794934	17大连银行CD046	1,500,000.00	148,317,735.45	1.76
10	111794770	17温州银行CD059	1,500,000.00	148,284,413.29	1.76

5.7"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0677%
报告期内偏离度的最低值	-0.0290%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0168%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内本基金未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内本基金未出现正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.9 投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

(1)基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际协议利率逐日计提利息;

(2)基金持有的回购协议(封闭式回购)以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;

(3)基金持有的附息债券,贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(4)基金持有的买断式回购以协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时,若双方都能履约,则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产,实际持有的相关资产按其性质进行估值;

(5)基金持有的资产支持证券视同债券,购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

5.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	19,989,558.89
4	应收申购款	6,818,111.19
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	26,807,670.08

5.9.4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	新华壹诺宝	新华壹诺宝B
本报告期期初基金份额总额	798,164,102.54	16,422,792,541.75
报告期基金总申购份额	3,220,814,965.72	10,783,937,620.29
报告期基金总赎回份额	3,609,445,312.54	19,197,124,186.03
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	409,533,745.72	8,009,605,976.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期管理人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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170116-20170331	2,033,333,529.37	0.00	0.00	2,052,343,490.54	24.38%
	2	20170113	2,501,205,587.12	0.00	2,503,054,751.53	402,622.12	0.00%

8.2 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壹诺宝货币市场基金募集的文件

(二)关于申请募集新华壹诺宝货币市场基金之法律意见书

(三)《新华壹诺宝货币市场基金托管协议》

(四)《新华壹诺宝货币市场基金基金合同》

(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《新华壹诺宝货币市场基金招募说明书》

(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

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

二〇一七年四月二十一日

新华优选成长混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华优选成长混合
基金主代码	519089
交易代码	519089
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2008年7月25日
报告期末基金份额总额	274,101,643.36份
投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,优选具有成长性兼具品质保障的上市公司为主要投资对象,力争持续地超越业绩比较基准,为投资者实现超额收益。
投资策略	本基金是混合型基金,选择具有成长性兼具品质保障的股票,因此主要采取自下而上的主动投资管理策略。当然仅应用自下而上的策略可能导致某行业股票集中度过高,行业配置不够分散,造成组合非系统风险高。再考虑到国内系统风险高,因此有必要辅助以适当的资产配置和行业配置策略进行调整。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金。基金资产整体的预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金,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	中国农业银行股份有限公司

§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(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	3,318,732.66
2.本期利润	6,093,027.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.0218
4.期末基金资产净值	396,895,781.36
5.期末基金份额净值	1.4115

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

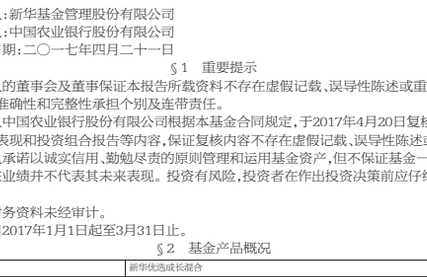
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.50%	0.95%	3.58%	0.41%	-2.08%	0.54%

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

新华优选成长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

(2008年7月25日至2017年3月31日)



注:本报告期末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		
付伟	本基金基金经理,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、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-08-25	-	7	西安交通大学工学硕士,北京大学工商管理硕士,7年证券从业经验。历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理,新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与TMT组组长,先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。现任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、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理、新华外延增长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,新华基金管理股份有限公司作为新华优选成长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》、《新华优选成长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、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

2017年一季度沪深300指数和中小板指数均上涨4%,但全市场中小市值风格指数如中证1000、2000均下跌1-2%。扣除约140只新股后统计,2017年一季度2940只可交易股票涨跌中位数为-2.6%,1203只上涨,1737只下跌,下跌家数占比59%。春节后41个交易日个股当日涨跌中位数累加-3.8%。一季度行情更多表现为少量权重较大的蓝筹、白马、金融指标股和一带一路、新疆等区域主题热点的一九式局部行情。典型代表如大权重的少数白酒、家电、医药、电子行业指标股一季度涨幅在20%左右。

综合来看,赚钱的难度还是很大,热点风格轮换很快,市场预期混乱,低估值低风险偏好的低估值白马股和高波动高风险的次新股同时获得较大的涨幅。今年,无论是企业盈利情况还是流动性情况都不如去年,市场的起伏主要来自于风险偏好的波动。

今年风险偏好缺少大幅提高的契机,全球政治经济形势不断爆出黑天鹅事件,偶然中孕育着必然,全球一体化的进程在民粹主义抬头的环境下,面临着转向的风险。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年3月31日,本基金份额净值0.7420元,本报告期份额净值增长率为1.10%,同期比较基准的增长率为2.74%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一个季度来看,全球资产价格处在高位,虽然宏观经济数据有所好转,但在货币收紧的大环境下,难以出现大幅提升的可能。相反,在四月法国大选、美国加息、联储缩表等负面因素下,风险偏好反而可能向下。因此操作上,降低仓位,配置更加防御的品种。

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	364,979,633.24	93.38
	其中:股票	364,979,633.24	93.38
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	25,067,469.33	6.41
7	其他各项资产	817,413.63	0.21
8	合计	390,864,516.20	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	2,497,000.00	0.65
B	采矿业	2,132,692.90	0.55
C	制造业	223,107,498.46	57.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,818,000.00	1.50
E	建筑业	3,366,282.50	0.87
F	批发和零售业	15,842,306.55	4.09
G	交通运输、仓储和邮政业	5,370.54	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,374,879.81	15.35
J	金融业	3,422,000.00	0.88
K	房地产业	19,167,138.80	4.95
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,215,930.16	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	7,496,534.32	1.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,581,000.00	0.41
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	18,962,999.20	4.90
S	综合	-	-
	合计	364,979,633.24	94.34

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	600760	中航黑豹	500,000	16,695,000.00	4.32
2	000403	ST生化	400,029	12,180,883.05	3.15
3	603626	科森科技	170,095	9,996,483.15	2.58
4	603160	汇顶科技	100,084	9,488,964.04	2.45
5	300223	北京君正	160,097	7,928,003.44	2.05
6	300188	美亚柏科	400,098	7,621,866.90	1.97
7	600570	恒生电子	180,000	7,605,000.00	1.97
8	002425	凯撒文化	400,000	7,392,000.00	1.91
9	300124	汇川技术	330,088	7,245,431.60	1.87
10	002195	二三四五	600,000	6,948,000.00	1.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金无债券投资。

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

本报告期末本基金无债券投资。

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

本报告期末本基金无资产支持证券投资。

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本报告期末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之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	222,636.68
2	应收证券清算款	498,587.58
3	应收股利	-
4	应收利息	5,393.22
5	应收申购款	90,796.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	817,413.63

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	300223	北京君正	7,928,003.44	2.05	筹划重大事项

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	280,393,402.41
报告期基金总申购份额	8,917,735.96
减:报告期基金总赎回份额	15,209,495.01
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	274,101,643.36

§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

本报告期本基金管理人未投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人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

8.1 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)中国证监会批准新世纪优选成长混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新世纪优选成长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)《新华优选成长混合型证券投资基金基金合同》

(五)《新华优选成长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《新华优选成长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

二〇一七年四月二十一日

新华优选分红混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| |