新华活期添利货币市场基金

【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:平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4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	新华活期添利货币	
基金主代码	000903	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年12月4日	
报告期末基金份额总额	1,296,815,618.18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,追求超越业绩比较基准的投资收益率。	
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	本基金业绩比较基准: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,其预期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	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新华活期添利	新华活期添利B
下属分级基金的交易代码	000903	003264
报告期末下属分级基金的份额总额	683,720,629.58份	613,094,988.60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)	
	新华活期添利	新华活期添利B
1.本期已实现收益	3,845,076.23	5,487,967.86
2.本期利润	3,845,076.23	5,487,967.86
3.期末基金资产净值	683,720,629.58	613,094,988.60

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、新华活期添利:

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	0.8741%	0.0049%	0.3334%	0.0000%	0.5407%	0.0049%

2、新华活期添利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	0.9337%	0.0049%	0.3334%	0.0000%	0.6003%	0.0049%

注:本基金利润分配是按日结转份额。

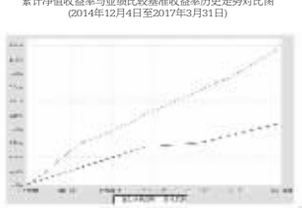
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华活期添利货币市场基金

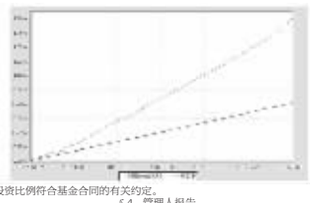
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年12月4日至2017年3月31日)

1、 新华活期添利



2、 新华活期添利B



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		
马英	本基金基金经理,新华睿诚宝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、新华睿诚宝货币市场基金基金经理助理。现任新华睿诚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。
李显君	本基金基金经理,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。	2016-07-08	-	9	工商管理及金融学硕士,9年证券从业经验。历任国家科技风险开发事业中心研究员、大公国际资信评估有限公司评级分析师、中国出口信用保险公司投资主办、中国人寿资产管理有限公司研究员和账户投资经理、光启负责宏观研究、信用评级、策略研究、投资交易、账户管理等工作。2016年4月加入新华基金管理股份有限公司。现任新华信用增强债券型证券投资基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理、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活期添利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》、《新华活期添利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

2017年一季度,市场稳中有升,热点板块不断轮换,家电、食品饮料、煤炭、银行、建材、交通运输等板块涨幅居前,产品净值表现平稳。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年3月31日,本基金份额净值为0.951元,本报告期份额净值增长率为-0.63%,同期比较基准的增长率为0.77%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计接下来市场不断有热点切换,京津冀、雄安、军工、环保、一带一路等板块可能存在机会,我们将保持密切关注。

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	8.70	
	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	-	-
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2017-01-09	27.93	投资组合需求	-
2	2017-01-10	25.31	投资组合需求	-
3	2017-01-11	22.66	投资组合需求	-
4	2017-03-10	21.12	投资组合需求	-
5	2017-03-13	21.13	投资组合需求	-
6	2017-03-14	21.44	投资组合需求	-
7	2017-03-15	20.50	投资组合需求	-

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	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	73
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过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	43.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	15.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	3.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	14.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		91.99	-

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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期无超过240天的情况。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	65,077,159.42	5.02
	其中:政策性金融债	65,077,159.42	5.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	229,953,669.65	17.73
6	中期票据	-	-
7	同业存单	465,665,163.31	35.91
8	其他	-	-
9	合计	760,695,992.38	58.66
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	011698065	16中融新大SCP004	500,000.00	49,999,662.58	3.86
2	011698103	16鲁能源SCP004	400,000.00	39,999,102.72	3.08
3	011698793	16鲁能源SCP007	300,000.00	29,991,277.67	2.31
4	011698937	16兖州煤业SCP008	300,000.00	29,990,164.79	2.31
5	111793109	17唐山银行CD039	300,000.00	29,978,350.04	2.31
6	111793183	17上饶银行CD008	300,000.00	29,978,105.44	2.31
7	111791469	17大连银行CD009	300,000.00	29,853,726.84	2.30
8	111791610	17锦州银行CD014	300,000.00	29,840,724.46	2.30
9	111791719	17桂林银行CD018	300,000.00	29,838,721.14	2.30
10	111791694	17乐山商行CD004	300,000.00	29,838,721.14	2.30

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	0.1617%
报告期内偏离度的最低值	-0.0092%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0898%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期无资产支持证券投资。

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	6,711,595.80
4	应收申购款	68,490,334.58
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	75,201,930.38

5.9.4投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金报告期无其他需要说明的重要事项。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	新华活期添利	新华活期添利B
本报告期期初基金份额总额	630,829,153.92	1,510,142,818.74
报告期基金总申购份额	968,264,627.40	326,218,489.29
报告期基金总赎回份额	915,373,151.74	1,223,266,319.53
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	683,720,629.58	613,094,988.60

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
-	赎回	2017-02-08	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
合计			-	-	

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金报告期未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

9.1 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	20170101-20170106	507,178,503.63	0.00	507,178,503.63	0.00	0.00%
	2	20170316-20170331	100,364,127.79	200,000,000.00	0.00	301,689,855.77	23.26%
	3	20170104-20170116	402,980,573.11	0.00	361,193,484.62	42,652,237.44	3.29%

9.2 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。

§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活期添利货币市场基金募集的文件

(二)关于申请募集新华活期添利货币市场基金之法律意见书

(三)《新华活期添利货币市场基金托管协议》

(四)《新华活期添利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《新华活期添利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

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
二〇一七年四月二十一日

新华健康生活主题灵活配置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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4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	新华健康生活主题灵活配置混合
基金主代码	002715
交易代码	002715
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月16日
报告期末基金份额总额	159,024,679.10份
投资目标	重点关注国家健康生活产业发展过程中带来的投资机会,综合运用多种投资策略,精选健康生活产业及其相关产业中的优质企业进行投资,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,大类资产配置策略主要运用战略性资产配置策略和战术性资产配置策略。股票投资策略指通过对健康生活产业发展状况的持续跟踪,以研究员以及基金经理的实地调研、密切跟踪以及扎实的案头分析工作为基础,采用自上而下与自下而上相结合的选股策略,动态精选能够充分受益于健康生活产业为主题的优质股票进行投资。具体运作方法包括对健康生活主题产业界定,行业配置策略、健康生活产业个股挖掘等方法。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(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-590,694.02
2.本期利润	6,669,041.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0272
4.期末基金资产净值	163,803,948.33
5.期末基金份额净值	1.030

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

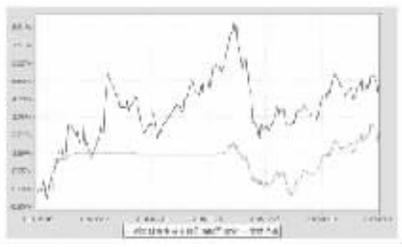
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.69%	0.27%	2.05%	0.32%	0.64%	-0.05%

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

新华健康生活主题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

(2016年6月16日至2017年3月31日)



注:1.本基金自2016年6月16日成立,截至报告期末基金合同生效未满一年。

2.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		
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、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理、新华资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016-06-16	-	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、新华资源优势灵活配置混合型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、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。	2016-11-03	-	7	工商管理硕士,7年证券从业经验,历任中信证券股份有限公司战略化投资经理、北京华证资本管理有限公司投资经理、中融国际信托有限公司投资经理。2016年3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、新华华瑞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。

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健康生活主题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》、《新华健康生活主题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

2017年一季度,市场稳中有升,热点板块不断轮换,家电、食品饮料、煤炭、银行、建材、交通运输等板块涨幅居前,产品净值表现平衡。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.030元,本报告期份额净值增长率为2.69%,同期比较基准的增长率为2.05%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计市场会维持震荡,难以大幅上涨或者下跌,存在结构性行情,操作上,提前布局稳健个股为主。

§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	107,097,720.61	64.77
	其中:股票	107,097,720.61	64.77
2	固定收益投资	9,910,000.00	5.99
	其中:债券	9,910,000.00	5.99
	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	42,900,300.00	25.94
	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	5,280,384.90	3.19
7	其他各项资产	162,807.52	0.10
8	合计	165,351,213.03	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	307,136.00	0.19
B	采矿业	1,179,103.00	0.72
C	制造业	40,655,790.55	24.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,186,673.00	0.72
E	建筑业	4,533,738.52	2.77
F	批发和零售业	3,584,657.00	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	2,853,646.54	1.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,622,638.00	2.21
J	金融业	37,156,609.00	22.68
K	房地产业	6,161,480.00	3.76
L	租赁和商务服务业	1,510,740.00	0.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,769,440.00	1.69
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	1,082,644.00	0.66
S	综合	493,425.00	0.30
	合计	107,097,720.61	65.38

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	601288	农业银行	2,073,600	6,925,824.00	4.23
2	600015	华夏银行	488,000	5,509,520.00	3.36
3	601318	中国平安	130,000	4,811,300.00	2.94
4	601939	建设银行	600,000	3,564,000.00	2.18
5	601555	东吴证券	282,600	3,119,610.00	1.90
6	601166	兴业银行	182,300	2,955,083.00	1.80
7	000783	长江证券	258,300	2,528,757.00	1.54
8	002179	中航光电	57,300	2,171,097.00	1.33
9	000776	广发证券	120,100	2,052,509.00	1.25
10	600030	中信证券	114,400	1,842,984.00	1.13

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	9,910,000.00	6.05
	其中:政策性金融债	9,910,000.00	6.05
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,910,000.00	6.05

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	100412	10农发12	100,000	9,910,000.00	6.05

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

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

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

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

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

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	37,099.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	122,113.33
5	应收申购款	3,594.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	162,807.52

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

本报告期末前十名股票不存在流通受限情况的说明。

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	209,321,355.11
报告期基金总申购份额	51,232,873.13
减:报告期基金总赎回份额	101,529,549.14
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	159,024,679.10

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 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	20170101-20170331	175,727,897.84	0.00	95,727,897.84	80,000,000.00	50.31%
	2	20170308-20170331	0.00	50,644,488.58	0.00	50,644,488.58	31.85%

7.2 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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《新华健康生活主题灵活配置混合型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《新华健康生活主题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

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

8.3 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

新华积极价值灵活配置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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4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