

新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

本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

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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

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

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

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

5.9 报告期末本基金无股指期货投资
5.10 报告期末本基金无国债期货投资

5.11 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.12 报告期末本基金持有的私募资产管理计划

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.17 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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

9 备查文件目录

10 存放地点

11 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询。

新华基金管理有限公司 2017年10月26日

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

重要提示
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。

基金的投资业绩并不预示其未来表现。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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。
2.1 基金产品概况

基金名称:新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金
基金代码:001902

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2016年12月21日

投资目标:本基金在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产净值长期稳定增值。

投资策略:本基金为主动管理型,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产净值长期稳定增值。

风险收益特征:本基金为主动管理型,属于证券投资基金中中等风险程度中等预期收益的混合型基金。

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

主要财务指标
1.本期已实现收益:7,300,527.96

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。

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。

3.2.1 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

过去三个月: 1.06% 0.01% 4.30% 0.06% -2.08% 0.26%

3.2.2 本基金合同生效以来(以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)

新华积极价值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

注:本报告期末本基金各项资产比例符合基金合同的约定。

4.1 基金基金经理或基金经理小组简介

基金经理:李志刚
任职日期:2016-03-21

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积极价值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》、《新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金合同》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。

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》。

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,根据合同制度,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。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截至2017年9月30日,本基金份额净值为0.943元,本报告期份额净值增长率为1.40%,同期比较基准的增长率为0.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
四季度将迎来十九大胜利召开,作为重中之重的大选,必将给当前和今后很长一段时间内的政治、经济、社会产生重大影响。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期末本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5.1 投资组合报告
5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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

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

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

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

5.9 报告期末本基金无股指期货投资
5.10 报告期末本基金无国债期货投资

5.11 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.12 报告期末本基金持有的私募资产管理计划

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.17 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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

9 备查文件目录

10 存放地点

11 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询。

新华基金管理有限公司 2017年10月26日

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

重要提示
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。

基金的投资业绩并不预示其未来表现。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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。
2.1 基金产品概况

基金名称:新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金代码:001904

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2016年12月21日

投资目标:本基金在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产净值长期稳定增值。

投资策略:本基金为主动管理型,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产净值长期稳定增值。

风险收益特征:本基金为主动管理型,属于证券投资基金中中等风险程度中等预期收益的混合型基金。

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

主要财务指标
1.本期已实现收益:7,586,918.06

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。

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。

3.2.1 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

过去三个月: 2.06% 0.06% 0.76% 0.01% 1.26% 0.64%

3.2.2 本基金合同生效以来(以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)

新华稳健回报灵活配置混合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历史走势对比图

注:本报告期末本基金各项资产比例符合基金合同的约定。

4.1 基金基金经理或基金经理小组简介

基金经理:曹晓红
任职日期:2016-03-21

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稳健回报灵活配置混合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》、《新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》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。

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》。

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,根据合同制度,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。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截至2017年9月30日,本基金份额净值为0.908元,本报告期份额净值增长率为2.02%,同期比较基准的增长率为0.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
四季度将迎来十九大胜利召开,作为重中之重的大选,必将给当前和今后很长一段时间内的政治、经济、社会产生重大影响。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期末本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5.1 投资组合报告
5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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

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

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

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

5.9 报告期末本基金无股指期货投资
5.10 报告期末本基金无国债期货投资

5.11 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.12 报告期末本基金持有的私募资产管理计划

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.17 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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

9 备查文件目录

10 存放地点

11 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询。

新华基金管理有限公司 2017年10月26日

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

重要提示
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。

基金的投资业绩并不预示其未来表现。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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。
2.1 基金产品概况

基金名称:新华科技主题灵活配置混合型证券投资基金
基金代码:001903

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2016年12月21日

投资目标:本基金在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产净值长期稳定增值。

投资策略:本基金为主动管理型,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产净值长期稳定增值。

风险收益特征:本基金为主动管理型,属于证券投资基金中中等风险程度中等预期收益的混合型基金。

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

主要财务指标
1.本期已实现收益:16,436,727.91

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。

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。

3.2.1 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

过去三个月: 1.67% 0.07% 4.01% 0.44% 4.17% 0.53%

3.2.2 本基金合同生效以来(以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)

新华科技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

注:本报告期末本基金各项资产比例符合基金合同的约定。

4.1 基金基金经理或基金经理小组简介

基金经理:李志刚
任职日期:2016-03-21

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科技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》、《新华科技主题灵活配置混合型证券投资基金合同》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。

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》。

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,根据合同制度,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。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.091元,本报告期份额净值增长率为0.82%,同期比较基准的增长率为0.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
四季度将迎来十九大胜利召开,作为重中之重的大选,必将给当前和今后很长一段时间内的政治、经济、社会产生重大影响。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期末本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5.1 投资组合报告
5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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

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

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

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

5.9 报告期末本基金无股指期货投资
5.10 报告期末本基金无国债期货投资

5.11 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.12 报告期末本基金持有的私募资产管理计划

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.17 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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

9 备查文件目录

10 存放地点

11 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询。

新华基金管理有限公司 2017年10月26日

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

重要提示
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。

基金的投资业绩并不预示其未来表现。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。

本报告自2017年7月1日起至9月30日止。
2.1 基金产品概况

基金名称:新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金
基金代码:001902

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2016年12月21日

投资目标:本基金在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产净值长期稳定增值。

投资策略:本基金为主动管理型,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产净值长期稳定增值。

风险收益特征:本基金为主动管理型,属于证券投资基金中中等风险程度中等预期收益的混合型基金。

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

主要财务指标
1.本期已实现收益:7,300,527.96

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。

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。

3.2.1 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

过去三个月: 1.06% 0.01% 4.30% 0.06% -2.08% 0.26%

3.2.2 本基金合同生效以来(以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)

新华积极价值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

注:本报告期末本基金各项资产比例符合基金合同的约定。

4.1 基金基金经理或基金经理小组简介