新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十六日

§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10月25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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华鑫安保本一号混合
基金主代码	519167
交易代码	519167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月18日
报告期末基金份额总额	1,499,500,402.73份
投资目标	综合运用投资组合保险策略,严格控制风险,在为投资人提供投资金额安全保证的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	在投资策略方面,本基金将主要采用可变比例组合保本策略(VPPI,Variable Proportion Portfolio Insurance),在保本期期内,基金管理人将严格依据所选择的量化策略模型对固定收益资产和风险资产的配置比例进行动态优化调整,以达到保本和锁定部分收益的目的。同时,本基金管理人将依据与担保人或保本义务人签订的风险管理协议,对基金资产进行严格的风险控制并适时调整投资组合。
业绩比较基准	(一年期银行定期存款税后收益率+1%)×15
风险收益特征	本基金为系极配置的保本混合型基金,属于证券投资基金当中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,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	中国农业银行股份有限公司
基金保证人	瀚华担保股份有限公司

§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7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	21,231,028.88
2.本期利润	2,690,788.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0018
4.期末基金资产净值	1,562,113,965.47
5.期末基金份额净值	1.042

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。

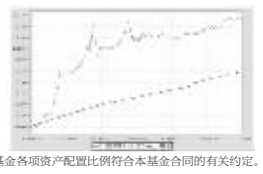
3.2 基金净值表现

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	0.19%	0.12%	0.95%	0.01%	-0.76%	0.11%

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

新华鑫安保本一号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6月18日至2017年9月30日)



注:本报告期,本基金各项资产配置比例符合本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		
赵楠	本基金基金经理,新华同鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理,新华丰利债券型证券投资基金基金经理。	2016-05-25	-	5	经济学博士,5年证券从业经验,2012年7月加入新华基金管理股份有限公司。先后从事宏观研究、策略研究、信用评级、历任新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理助理、新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理助理,现任新华同鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理。
王滨	本基金基金经理,固定收益与平衡投资策略总监,新华资讯主任市场基金基金经理,新华纯债添利货币市场基金基金经理,新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。	2017-07-13	-	10	管理学硕士,10年证券从业经验。历任中国工商银行总行固定收益投资经理、中国民生银行投资经理、长生人寿投资管理有限公司基金经理,2016年4月加入新华基金管理股份有限公司,现任固定收益与平衡投资策略总监、新华增诚宝货币市场基金基金经理、新华鑫安保本一号混合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、新华增盈回报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鑫安保本一号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》、《新华鑫安保本一号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。

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年三季度,债券市场呈现震荡走势,资金价格波动率继续加大,一是由于国内二季度经济数据好于预期,二是外部经济体基本面持续走强,三是金融强监管政策思路明确。权益市场受基本面驱动大幅上行,金融板块和周期板块有较好的相对收益。

本报告期内,本基金继续以审慎操作为主要思路。债券投资上,以短久期存单进行配置获取稳定持有收益,权益投资上,仓位进行了动态调整,三季度投资收益相对一般。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.042元,本报告期份额净值增长率为0.19%,同期比较基准的增长率为0.95%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为债券市场经历长时间调整后绝对收益率水平相对提高,但鉴于国内经济增长动力依然较强,同时考虑到在全球基本面持续好转的大背景下,叠加货币政策中性政策取向,短期内长端收益率水平趋势性下行的概率不大。

权益市场也受益于内外部基本面整体改善,未来整体偏乐观。其中行业基本面维持高景气的各行业龙头及MSCI相关标的,在A股国际化的大背景下,预计在中长期依旧有良好的表现。

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况。

§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	344,310,913.49	21.39
	其中:股票	344,310,913.49	21.39
2	固定收益投资	660,802,045.10	41.06
	其中:债券	660,802,045.10	41.06
	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	251,410,420.00	15.62
	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	330,065,820.97	20.51
7	其他各项资产	22,770,554.52	1.41
8	合计	1,609,359,754.08	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	7,988,786.60	0.51
C	制造业	64,115,911.55	4.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	41,637,036.00	2.67
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	230,340,453.46	14.75
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	344,310,913.49	22.04

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	601336	新华保险	660,000	37,402,200.00	2.39
2	601318	中国平安	579,900	31,407,384.00	2.01
3	601628	中国人寿	1,098,600	30,475,164.00	1.95
4	601601	中国太保	824,800	30,459,864.00	1.95
5	601618	中国中冶	4,543,200	23,261,184.00	1.49
6	601669	中国电建	2,288,400	18,375,852.00	1.18
7	600109	国金证券	1,533,100	17,983,263.00	1.15
8	600873	梅花生物	2,792,600	17,872,640.00	1.14
9	601939	建设银行	2,411,564	16,808,601.08	1.08
10	601788	光大证券	1,002,000	15,561,060.00	1.00

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	10,767,719.70	0.69
5	企业短期融资券	60,159,000.00	3.85
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	9,688,325.40	0.62
8	同业存单	580,187,000.00	37.14
9	其他	-	-
10	合计	660,802,045.10	42.30

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	111625449	16包商银行CD090	1,500,000	143,490,000.00	9.19
2	111780064	17中原银行CD135	700,000	68,397,000.00	4.38
3	111799352	17长沙银行CD056	500,000	48,795,000.00	3.12
4	111682571	16徽商银行CD123	500,000	47,940,000.00	3.07
5	111682582	16包商银行CD091	500,000	47,900,000.00	3.07

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

本基金报告期末无贵金属投资。

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

本基金本报告期无权证投资。

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

本基金报告期末无股指期货投资。

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

本基金报告期无国债期货投资持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期无国债期货投资。

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本报告期内,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	333,795.59
2	应收证券清算款	3,311,999.48
3	应收股利	-
4	应收利息	19,124,769.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,770,554.52

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转债。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中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

本报告期期初基金份额总额	1,499,500,402.73
报告期基金总申购份额	-
减:报告期基金总赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,499,500,402.73

注:本基金本报告期处于封闭期,无申赎交易。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金无基金管理人运用固有资金投资本基金交易的情况。

§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

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	20170701-20170930	450,051,593.73	-	-	450,051,593.73	30.01%
产品特有风险							

1、赎回申请延期办理的风险
机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,中小投资者可能面临小额赎回,中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险;
2、基金净值大幅波动的风险
机构投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;
3、提前终止基金合同的风险
机构投资者赎回后,可能出现基金资产净值低于5000万元的情形,若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人可能提前终止基金合同,基金财产将进行清算;
4、基金规模过小导致的风险
机构投资者赎回后,可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

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)中国证监会核准新华鑫安保本一号混合型证券投资基金募集的文件

(二)《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》

(三)《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金托管协议》

(四)更新的《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书》

(五)关于申请募集新华鑫安保本一号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
二〇一七年十月二十六日

新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十六日

§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10月25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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华鑫弘灵活配置混合
基金主代码	003739
交易代码	003739
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月30日
报告期末基金份额总额	200,036,386.80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,力争持续实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	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和定量分析相结合的方法,在把握宏观经济走势及其变化对市场和相关产业的影响的前提下,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,并且充分发挥投研团队的主动选股能力,精选优质股票构建投资组合。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、骑乘策略、可转换债券投资策略等。并选择流动性好、风险溢价水平合理、到期收益率和信用质量较高的品种。
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	中国建设银行股份有限公司

§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7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	1,944,406.36
2.本期利润	5,012,460.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0251
4.期末基金资产净值	204,622,986.99
5.期末基金份额净值	1.0229

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11月30日,至2017年6月30日披露日未满一年。

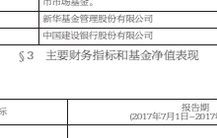
3.2 基金净值表现

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	2.51%	0.15%	2.61%	0.35%	-0.10%	-0.20%

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

新华鑫弘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11月30日至2017年9月30日)



注:1、本基金自2016年11月30日成立,截至报告期末基金合同生效未满一年。

2、本报告期,本基金已完成建仓,各项资产配置比例符合本基金合同约定。

§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,新华稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫益灵活配置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,新华鑫安保本一号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,新华鑫新兴产业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,新华鑫益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。	2016-12-27	-	22	经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员、中银万国天津分公司证券投资经理兼投资经理、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信托高级投资经理。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、新华稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益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、新华鑫安保本一号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、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫新兴产业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、新华鑫益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,新华鑫益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,新华稳健回报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,新华鑫益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,新华鑫新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016-11-30	-	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量化投资经理、北京东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3月加入新华基金管理股份有限公司。现任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、新华鑫益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、新华稳健回报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、新华鑫新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益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弘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》、《新华鑫弘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。

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

三季度,市场热点较多,各指数都呈现出上涨季线。其中周期股、金融股表现亮眼。我们通过提高仓位获取贝塔收益,并通过择优获取阿尔法收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.0229元,本报告期份额净值增长率为2.51%,同期比较基准的增长率为2.61%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场风险偏好有所提升,融资余额接近万亿,热点板块较多,且持续性加强。随着监管的有效引导,投资者结构变化,稳健向好的基本面成为驱动股价的主要因素。

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	53,444,298.22	25.92
	其中:股票	53,444,298.22	25.92
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	139,700,000.00	67.75
	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	12,807,370.67	6.21
7	其他各项资产	248,632.73	0.12
8	合计	206,200,301.62	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	39,793.60	0.02
C	制造业	67,140,372.11	30.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,535,000.00	3.45
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,522,385.45	5.73
G	交通运输、仓储和邮政业	5,292,245.06	2.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,022,584.31	9.61
J	金融业	21,466,800.00	9.82
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	3,875,750.00	1.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.05
R	文化、体育和娱乐业	5,674,281.74	2.59
S	综合	2,078,400.00	0.95
	合计	146,762,912.26	67.11

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	600036	招商银行	154,000	3,934,700.00	1.92
2	600900	长江电力	197,500	2,976,325.00	1.45
3	601688	华泰证券	125,000	2,827,500.00	1.38
4	002244	滨江集团	368,337	2,508,374.97	1.23
5	600887	伊利股份	88,800	2,442,000.00	1.19
6	600028	中国石化	407,500	2,404,250.00	1.17
7	600328	兰太实业	180,000	2,266,200.00	1.11
8	600741	华域汽车	100,000	2,255,000.00	1.10
9	601377	兴业证券	250,700	2,123,429.00	1.04
10	601328	交通银行	324,900	2,053,368.00	1.00

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

本基金本报告期末无债券投资。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末持有贵金属。

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 2016年11月28日华泰证券收到中国证监会《行政处罚决定书》,经查明。华泰证券存在以下违法事实:截止调查日华泰证券有455个使用杭州恒生网络技术服务有限公司HOMS系统,61个使用浙江核新同花顺网络信息股份有限公司系统接入违规交易的主账户,对上述客户,华泰证券未按要求采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息,证监会对华泰证券给予警告,没收违法所得18235275.00元并处以54705825.00元罚款。

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	8,985.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	239,647.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	248,632.73

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

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	600328	兰太实业	2,266,200.00	1.11	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	200,009,647.52
报告期基金总申购份额	67,968.45
减:报告期基金总赎回份额	41,229.17
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	200,036,386.80

§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