

新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

比较基础的增长率为1.31%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,经济在环保影响下目前阶段继续上行,但下行风险依然较大,同时货币政策稳中偏紧,大宗商品大幅下跌,但四季度也缺少大幅下跌的诱因,经济下行在市场的预期之内,且不排除快速下行,更多可能是小幅下行,货币政策趋紧但也不会出现信号性的紧缩政策。

四季度市场表现为窄幅震荡的可能性更大,从结构上看自下而上依然能选出投资机会。因此市场表现为窄幅震荡的可能性更大,从结构上看自下而上依然能选出投资机会。

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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 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

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 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 5 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 报告期末按品种分类的债券投资组合

本报告期末基金未持有债券投资。

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十名资产支持证券投资明细

本报告期末基金未持有资产支持证券投资。

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五名贵金属投资明细

本报告期末基金未持有贵金属。

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权证投资明细

本报告期末基金未持有权证投资。

5.8 报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期末基金未持有股指期货。

5.9 报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末基金未持有国债期货。

5.10 报告期末基金投资的期权交易情况说明

本报告期末基金未持有期权投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期末基金投资的前十名证券没有在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。

5.11.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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,分项之和与合计之间可能存在尾差。

5.12 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。

5.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.13.1 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.13.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.13.3 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中不存在流通受限的情况。

5.13.4 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,分项之和与合计之间可能存在尾差。

5.13.5 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。

5.13.6 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.13.7 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.13.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.13.9 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中不存在流通受限的情况。

5.13.10 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。

5.13.11 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。

5.13.12 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.13.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.13.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.13.15 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中不存在流通受限的情况。

5.13.16 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。

5.13.17 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。

5.13.18 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.13.19 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.13.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

基金管理人:新华基金管理有限公司
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

3.1 重要提示
3.1.1 重要提示
3.1.2 重要提示

3.2 基金产品概况
3.2.1 基金产品概况
3.2.2 基金产品概况

3.3 主要财务指标
3.3.1 主要财务指标
3.3.2 主要财务指标

3.4 管理人报告
3.4.1 管理人报告
3.4.2 管理人报告

3.5 投资组合报告
3.5.1 投资组合报告
3.5.2 投资组合报告

3.6 其他资产构成
3.6.1 其他资产构成
3.6.2 其他资产构成

3.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
3.7.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
3.8.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.9 投资组合报告附注的其他文字描述部分
3.9.1 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.10 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。

3.11 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.1 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.5 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。

3.11.6 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.7 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.10 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.11 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。

3.11.12 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.17 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。

3.11.18 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.19 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.22 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.23 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。

3.11.24 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.25 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.28 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.29 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。

3.11.30 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.31 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.34 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.35 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。

3.11.36 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.37 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.40 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.41 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。

3.11.42 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.43 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.45 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.46 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.47 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。

3.11.48 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.49 其他资产构成

基金管理人:新华基金管理有限公司
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

3.1 重要提示
3.1.1 重要提示
3.1.2 重要提示

3.2 基金产品概况
3.2.1 基金产品概况
3.2.2 基金产品概况

3.3 主要财务指标
3.3.1 主要财务指标
3.3.2 主要财务指标

3.4 管理人报告
3.4.1 管理人报告
3.4.2 管理人报告

3.5 投资组合报告
3.5.1 投资组合报告
3.5.2 投资组合报告

3.6 其他资产构成
3.6.1 其他资产构成
3.6.2 其他资产构成

3.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
3.7.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
3.8.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.9 投资组合报告附注的其他文字描述部分
3.9.1 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.10 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。

3.11 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.1 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.5 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。

3.11.6 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.7 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.10 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.11 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。

3.11.12 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.13 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.17 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。

3.11.18 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.19 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.22 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.23 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。

3.11.24 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.25 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.28 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.29 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。

3.11.30 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.31 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.34 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.35 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。

3.11.36 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.37 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.40 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.41 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。

3.11.42 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.43 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3.11.45 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

3.11.46 投资组合报告附注的其他文字描述部分

3.11.47 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。

3.11.48 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

3.11.49 其他资产构成

新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

决策、交易执行等投资管理活动各个环节。

场内交易,投资指令统一由交易部下达,并且自动交易系统公平交易模块,根据合同制度,严格执行不同投资组合之间互为对手方的交易,并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配售。如有异议,由交易部报投资决策、督察长、合规风控部和监察稽核部,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审核和审议。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所下达投资指令,交易部向银行间市场或交易所对手询价、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。