新华丰利债券型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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	新华丰利债券	
基金主代码	003221	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月26日	
报告期末基金份额总额	259,430,632.24份	
投资目标	本基金在严格控制投资风险并保持较高资产流动性的前提下,通过配置债券等固定收益类金融工具,追求基金资产的长期稳定增值,通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。	
投资策略	本基金的投资策略主要包括:大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。首先,本基金管理人将采用战略性与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,在严格控制基金风险的基础上,获取长期稳定的绝对收益。另外,本基金通过自下而上的个股精选策略,精选具有持续成长且估值相对合理的股票构建权益类资产投资组合,增加基金的获利能力,以提高整体的收益水平。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新华丰利债券A	新华丰利债券C
下属分级基金的交易代码	003221	003222
报告期末下属分级基金的份额总额	164,897,910.00份	94,532,722.24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7月1日-2017年9月30日)	
	新华丰利债券A	新华丰利债券C
1.本期已实现收益	3,496,124.60	2,011,530.90
2.本期利润	4,482,204.19	2,625,588.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0226	0.0216
4.期末基金资产净值	172,605,765.04	98,563,651.74
5.期末基金份额净值	1.0467	1.0426

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10月26日,至2017年9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

1、新华丰利债券A:

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	2.27%	0.18%	0.33%	0.06%	1.94%	0.12%

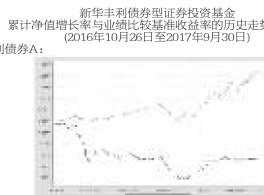
2、新华丰利债券C:

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	2.16%	0.18%	0.33%	0.06%	1.83%	0.12%

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

新华丰利债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016年10月26日至2017年9月30日)

1. 新华丰利债券A:



注:1、本基金自2016年10月26日成立,截至报告期末基金合同生效未满一年。
2、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。

2. 新华丰利债券C:

注:1、本基金自2016年10月26日成立,截至报告期末基金合同生效未满一年。
2、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		
姚秋	本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司固定收益与平衡投资部总监、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理、新华阿里一号保本混合型证券投资基金。	2016-10-26	-	8	经济学博士、注册金融分析师,历任中国建设银行北京分行投资银行部投资研究工作、中国工商银行资产管理部固定收益投资经理。2014年4月加入新华基金管理股份有限公司。现任新华基金管理股份有限公司固定收益与平衡投资部总监、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理、新华阿鑫二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、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理。
赵楠	本基金基金经理,新华阿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。	2017-08-16	-	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。现任新华阿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。

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丰利债券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》、《新华丰利债券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年三季度,经济基本面延续上半年的温和复苏局面,工业数据呈现出数量指标疲弱、价格指标上行的态势,流动性状况偏紧,财政政策力度无明显变化。经济未出现明显下行拐点,同时也缺乏持续拉动经济向好的新动能。

股票方面,我们维持对由市场风格导致的蓝筹偏好特征的谨慎态度;我们坚持从产业结构变革中寻找受益的细分行业和标的。我们适当增配了一些前期受市场关注度较低但发展前景较好且业绩增速较快的标的,包括医药、地产、食品、轻工等行业的标的。我们并不尝试预测蓝筹行情何时终结,而是从公司自身价值及成长性出发甄选标的,如果市场风格不断向极端方向演进,则会给基本面投资者带来更好的买入机会。

债券方面,我们适当拉长了组合久期,使得组合的到期收益率有所上行,但利率风险暴露仍然较小。随着存量债券的到期,我们新增的债券投资久期主要分布在2年左右。转债方面,由于优质标的稀缺、部分新上市的大盘转债转股溢价率仍然较高,我们仅参与了一级市场申购,依然没有参与二级市场投资。

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A类份额净值为1.0467元,本报告期份额净值增长率为2.27%,同期比较基准的增长率为0.33%;本基金C类份额净值为1.0426元,本报告期份额净值增长率为2.16%,同期比较基准的增长率为0.33%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济已经进入一个平台整理期,而四季度大概率仍处于此区间中。一方面,经济复苏的惯性仍然存在,长达7年的投资下滑期导致库存回补的时间被拉长,但需求端的动能仍然来自于地产和基建等相关产业,供给侧改革在强化大企业竞争优势的同时,也在对小企业的员工就业和工资收入产生挤出效应,这将会削弱未来的消费需求;另一方面,这个平台期的持续时间不会太长,一旦产能和库存调整接近尾声,供给收缩带来的价格体系重构将告一段落。同时,如果没有外部事件冲击,通胀水平有望维持低位,PPI向CPI的传导效应不明显。不同于此前的朱格拉周期,这个平台整理期可能是短经济周期、长经济周期和经济政策共振而产生的一个特殊阶段产物,后面反复出现的可能性也不大。货币政策方面,四季度可能仍会维持金融降杠杆的基调,货币政策可能不会边际收紧但大幅放松的可能性较小。

在此情况下,股票市场对短期估值水平看似偏低或景气度短期向好的蓝筹品种的偏好度可能仍会维持,但其中蕴含的风险将逐步加大;供给侧改革带来的中上游产业集中度提升、进而使部分行业龙头公司盈利状况得以快速提升,但其中蕴含的投资机会并不容易把握。一方面,上述品种代表着旧经济中的供给,在技术进步短期停滞与供给面短期修复的共振效应下,这些标的在业绩上呈现出快速增长,但这种增长难以持续太长时间;另一方面,趋势一旦形成,趋势中的受益者会主动或被动地吸附更多的增量资金、进而再配置进来,从而导致趋势的自我强化,甚至是如2007年和2015年股市见顶前那种脱离基本面的自我强化。

在这样的市场中,我们既要尊重市场的运行规律和运行特征,也要努力屏蔽市场情绪对自身投资操作的影响,从衣食住行的消费特征变革、医药产业与养老产业的供需两方面变化、娱乐与教育的行业进步等视角出发,坚持从行业和公司的基本面着眼进行投资决策。

对于债市,目前的收益率水平已经高于历史平均水平,但收益率本身尚未高到可以忽略其他影响因素而独自反转的能力。在货币政策和监管基调尚未有明显变化前,长久期债券的投资机会尚不明确,但配置中等久期的风险已经显著下降。对于转债,年底前新券供给有望大幅放量,届时市场整体的转股溢价率有望被拉低,使转债市场重新进入可配置阶段。目前的转债市场仍处于跟随股票市场的特征中,但较高的转股溢价率导致下行风险保护作用不明显。

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	53,438,363.48	17.42
	其中:股票	53,438,363.48	17.42
2	固定收益投资	235,969,276.00	76.92
	其中:债券	235,969,276.00	76.92
	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	6,900,000.00	2.25
	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	2,570,078.46	0.84
7	其他各项资产	7,885,298.21	2.57
8	合计	306,763,016.15	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	-	-
C	制造业	33,828,449.48	12.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,513,774.00	1.66
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,801,860.00	1.77
K	房地产业	10,294,280.00	3.80
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,438,363.48	19.71

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	002332	仙琚制药	1,054,700	9,207,531.00	3.40
2	600048	保利地产	684,700	7,120,880.00	2.63
3	600521	华海药业	275,995	6,187,807.90	2.28
4	600015	华夏银行	518,000	4,801,860.00	1.77
5	300436	广生堂	109,024	4,403,479.36	1.62
6	002422	科伦药业	212,500	3,871,750.00	1.43
7	000028	国药一致	52,200	3,532,374.00	1.30
8	000732	泰禾集团	180,000	3,173,400.00	1.17
9	002001	新和成	110,000	2,812,700.00	1.04
10	600867	通化东宝	103,625	1,999,962.50	0.74

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	4,473,762.00	1.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	75,380,000.00	27.80
	其中:政策性金融债	75,380,000.00	27.80
4	企业债券	65,778,464.00	24.26
5	企业短期融资券	90,236,000.00	33.28
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	101,050.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	235,969,276.00	87.02

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	160210	16国开10	400,000	36,672,000.00	13.52
2	150218	15国开18	300,000	28,722,000.00	10.59
3	011754008	17豫投资SCP001	200,000	20,102,000.00	7.41
4	011754038	17金隅SCP002	200,000	20,100,000.00	7.41
5	011751086	17厦国贸集SCP002	200,000	20,014,000.00	7.38

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券投资。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本报告期末本基金未持有权证投资。

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	29,358.17
2	应收证券清算款	4,111,618.28
3	应收股利	-
4	应收利息	3,726,821.76
5	应收申购款	17,500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,885,298.21

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

本基金本报告期前十名股票不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	新华丰利债券A	新华丰利债券C
本报告期期初基金份额总额	230,861,652.38	138,465,345.65
报告期基金总申购份额	808,536.06	5,748,027.59
减:报告期基金总赎回份额	66,772,278.44	49,680,651.00
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	164,897,910.00	94,532,722.24

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末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丰利债券型证券投资基金募集的文件
(二)关于申请募集新华丰利债券型证券投资基金之法律意见书
(三)《新华丰利债券型证券投资基金托管协议》
(四)《新华丰利债券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《新华丰利债券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
二〇一七年十月二十六日

新华丰盈回报债券型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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	新华丰盈回报债券
基金主代码	002866
交易代码	002866
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	998,914,413.92份
投资目标	在严格控制投资风险并保持较高资产流动性的前提下,通过配置债券等固定收益类金融工具,追求基金资产的长期稳定增值,通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括:大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。首先,本基金管理人将采用战略性与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。在此基础之上,一方面综合运用久期策略、收益率曲线策略以及信用策略进行固定收益类资产投资组合的构建;另一方面采用自下而上的个股精选策略,精选具有持续成长性且估值相对合理,同时股价具有趋势向上的股票构建权益类资产投资组合,以提高基金的整体收益水平。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,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7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	13,334,004.97
2.本期利润	17,994,289.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0180
4.期末基金资产净值	1,075,537,899.83
5.期末基金份额净值	1.077

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	1.70%	0.12%	0.33%	0.06%	1.37%	0.06%

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

新华丰盈回报债券型证券投资基金
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9月30日)

注:1、本报告期末本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

§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,新华安享惠金定期开放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、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。	-	-	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丰盈回报债券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》、《新华丰盈回报债券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年三季度,经济基本面韧性较强,数据表现平稳,货币政策紧平衡,长端利率债盘整,其中10年国债收益率维持窄幅振荡,低点3.56%,高点3.66%。资金面较为紧张,R007一直处于相对高位。信用债方面,中高等级债券利率小幅上行,短融信用利差走扩,中票信用利差收窄。股票市场,大盘普涨,中小板整体表现好于上证50。

本基金配置:债券方面,持仓仍为信用债,中短久期为主;股票方面,持仓变动不大,以低估值、经营稳健的蓝筹股为主,逢低适当增加了部分新标的。净值稳步增长。

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1.077元,本报告期份额净值增长率为1.70%,同期比较基准的增长率为0.33%。

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,房地产周期向下,各地调控政策频出;基建受制于资金来源,存在下行压力,经济数据四季度温和回落、监管冲击弱化、外占改善等因素或有利于债市。但仍需关注到一些负面因素:经济韧性仍存,金融监管后续可能会密切出台相关政策,货币政策态度偏紧,央行公开市场削峰填谷,紧平衡的资金面或继续;外围主要国家利率出现一定幅度回升,美联储12月份加息概率增大等。短期债市趋势性机会尚未显现。股票市场,或仍是存量博弈的结构性行情,业绩稳定、估值与盈利相匹配的绩优股仍有优势。

债券投资方面,本基金短期仍将配置于短久期的信用品种,获得稳定的票息收入,等待长端机会,四季度视市场调整幅度适度拉长组合久期;随着转债一级市场的供给放量,未来可选品种丰富及个券的流动性改善,继续关注,适时配置为组合提供弹性收入。股票投资方面,短期维持目前的持仓;对于涨幅过大、估值与业绩无法匹配的品种,进行替换,参与一些估值已具备吸引力、业绩改善明显、国家政策支持扶植、行业发展空间大的龙头公司机会。

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	196,051,270.33	17.72
	其中:股票	196,051,270.33	17.72
2	固定收益投资	889,909,639.00	80.42
	其中:债券	889,909,639.00	80.42
	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	5,371,855.17	0.49
7	其他各项资产	15,201,391.92	1.37
8	合计	1,106,534,156.42	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	7,726,671.54	0.72
C	制造业	53,760,061.01	5.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,515,175.56	0.23
E	建筑业	3,961,008.00	0.37
F	批发和零售业	13,315,717.00	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	10,391,976.28	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	75,191,449.40	6.99
K	房地产业	17,543,888.52	1.63
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	10,293,785.61	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,351,537.41	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	196,051,270.33	18.23

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	601318	中国平安	320,000	17,331,200.00	1.61
2	600030	中信证券	806,417	14,668,725.23	1.36
3	601939	建设银行	1,741,781	12,140,213.57	1.13
4	601988	中国银行	2,800,500	11,538,060.00	1.07
5	600036	招商银行	403,340	10,305,337.00	0.96
6	601607	上海医药	419,800	9,966,052.00	0.93
7	600048	保利地产	910,070	9,464,728.00	0.88
8	601006	大秦铁路	954,500	8,351,875.00	0.78
9	601088	中国神华	368,991	7,726,671.54	0.72
10	600104	上汽集团	218,609	6,599,805.71	0.61

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	49,606,600.00	4.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	122,950,866.90	11.43
5	企业短期融资券	679,215,300.00	63.15
6	中期票据	37,096,800.00	3.45
7	可转债(可交换债)	1,040,072.10	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	889,909,639.00	82.74

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	041659049	16苏农垦CP001	500,000	50,210,000.00	4.67
2	011761063	17柯桥国资SCP004	450,000	45,076,500.00	4.19
3	020189	17贴现33	420,000	41,668,200.00	3.87
4	011754021	17株洲城建SCP001	400,000	40,200,000.00	3.74
5	011754072	17邵阳城建SCP001	400,000	40,200,000.00	3.74

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

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本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2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	23,733.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,177,658.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,201,391.92

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128013	洪涛转债	177,082.50	0.02

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票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	998,917,063.05
报告期基金总申购份额	14,515.11
减:报告期基金总赎回份额	17,164.24
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	998,914,413.92

§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	20170701-20170930	496,523,336.64	-	-	496,523,336.64	49.71%
	2	20170701-20170930	497,560,000.00	-	-	497,560,000.00	49.81%

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。

7.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末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丰盈回报债券型证券投资基金募集的文件
(二)关于申请募集新华丰盈回报债券型证券投资基金之法律意见书
(三)《新华丰盈回报债券型证券投资基金托管协议》
(四)《新华丰盈回报债券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《新华丰盈回报债券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
二〇一七年十月二十六日

新华中证环保产业指数分级证券投资基金

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	新华中证环保产业指数分级		
场内简称	新华环保		
基金主代码	164304		
交易代码	164304		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年9月11日		
报告期末基金份额总额	191,309,784.07份		
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%		
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在中证环保产业指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	95%×中证环保产业指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金是指数型基金,具有较高预期收益、较高预期风险的特征。预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。从本基金的基金份额来看,新华环保A份额为稳健收益类份额,具有低预期风险且预期收益相对较低的特征;新华环保B份额为积极收益类份额,具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。		
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	新华环保A	新华环保B	新华环保
下属分级基金的场内简称	NCF环保A	NCF环保B	新华环保
下属分级基金的交易代码	150190	150191	164304
报告期末下属分级基金的份额总额	37,729,869.00份	37,729,869.00份	115,850,046.07份
风险收益特征	低预期风险且预期收益相对较低。	高预期风险且预期收益相对较高。	较高预期收益、较高预期风险。

§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	-2,862,907.07
2.本期利润	14,133,299.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0694
4.期末基金资产净值	223,015,541.83
5.期末基金份额净值	1.166

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。

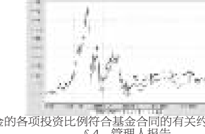
3.2 基金净值表现

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	6.58%	0.89%	6.71%	0.88%	-0.13%	0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

新华中证环保产业指数分级证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年9月11日至2017年9月30日)



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		
邓岳	本基金基金经理。	2017-08-07	-	9	信息与信号处理专业硕士,9年证券从业经验。历任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员,国信证券股份有限公司量化研究员,光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理,盈融达投资(北京)有限公司投资经理。2017年6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。
张永超	本基金基金经理,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、新华鑫丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华华盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华华荣灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016-07-20	2017-09-01	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、北京乐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、新华鑫丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华华盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华华荣灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华恒益量化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中证环保产业指数分级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》、《新华中证环保产业指数分级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

本基金为指数基金,以对标的指数的有效跟踪为投资目标。

2017年第三季度,本基金采用完全复制的被动式指数投资方法,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,产品紧密跟踪了指数的走势,保持了较小的跟踪误差。

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1.166元,本报告期份额净值增长率为6.58%,同期比较基准的增长率为6.71%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来本基金将延续同样的投资策略,紧跟标的指数,争取进一步缩小和指数走势的偏离度。

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	211,513,744.85	94.38
	其中:股票	211,513,744.85	94.38
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	11,839,775.72	5.28
7	其他各项资产	754,225.20	0.34
8	合计	224,107,745.77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	3,612,674.00	1.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,612,674.00	1.62

5.2.2指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	134,312,377.61	60.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,743,335.36	12.89
E	建筑业	13,957,440.23	6.26
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,228,990.97	3.69
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,759,670.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,783,190.18	8.42
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	-	-
S	综合	2,116,066.50	0.95
	合计	207,901,070.85	93.22

5.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	601012	隆基股份	122,011	3,595,664.17	1.61
2	600884	杉杉股份	136,338	3,288,472.56	1.47
3	002340	格林美	375,232	3,249,509.12	1.46
4	300274	阳光电源	186,962	3,146,570.46	1.41
5	002056	横店东磁	277,888	3,023,421.44	1.36
6	300355	蒙草生态	220,180	2,842,523.80	1.27
7	300317	珈伟股份	141,909	2,721,814.62	1.22
8	002366	台海核电	93,610	2,652,907.40	1.19
9	300323	华灿光电	143,100	2,637,333.00	1.18
10	000690	宝新能源	326,844	2,601,678.24	1.17

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002129	中环股份	338,900.00	3,612,674.00	1.62

注:报告期末,本基金积极投资有且仅持有一只股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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

报告期末,本基金未持有债券。

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

报告期末,本基金未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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 杉杉股份于2017年8月22日收到中国证券监督管理委员会宁波监管局下发的《关于对宁波杉杉股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》([2017]19号)和《关于对杉杉控股有限公司采取责令改正监管措施的决定》([2017]20号)。经查明,杉杉股份存在以下违法事实:1. 公司违反了《上市公司监管指引第2号——上市公司募集资金管理和使用的监管要求》第五条相关规定。2. 公司违反了《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十条相关规定。3. 公司违反了《上市公司信息披露管理办法》第四十八条"上市公司董事、监事、高级管理人员、持股5%以上的股东及其一致行动人、实际控制人应当及时向上市公司董事会报送上市公司关联人名单及关联关系的说明"相关规定。4. 公司违反了出具的避免同业竞争承诺函相关内容。

本报告期内,本基金投资的其他前十名证券的发行主体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。

5.11.2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	14,976.65
2	应收证券清算款	672,763.71
3	应收股利	-
4	应收利息	2,282.67
5	应收申购款	64,202.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	754,225.20

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期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2期末积极投资前五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	002129	中环股份	3,612,674.00	1.62	筹划重大事项,停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	新华环保A	新华环保B	新华环保
本报告期期初基金份额总额	42,358,045.00	42,358,045.00	132,422,218.30
报告期基金总申购份额	-	-	3,274,767.14
减:报告期基金总赎回份额	-	-	29,103,291.37
报告期基金拆分变动份额	-4,628,176.00	-4,628,176.00	9,256,352.00
本报告期期末基金份额总额	37,729,869.00	37,729,869.00	115,850,046.07

注:拆分变动份额包括三类份额之间的配对转换份额、定期折算和不定期折算调整份额。

§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

本基金管理人本报告期末持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期末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

本基金本报告期末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中证环保产业指数分级证券投资基金募集的文件
(二)关于申请募集新华中证环保产业指数分级证券投资基金之法律意见书
(三)《新华中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议》
(四)《新华中证环保产业指数分级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《新华中证环保产业指数分级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
(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
二〇一七年十月二十六日