新华泛资源优势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	新华泛资源优势混合
基金主代码	519091
交易代码	519091
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2009年7月13日
报告期末基金份额总额	413,824,868.83份
投资目标	在有效控制风险的前提下，通过重点精选与集中配置具有社会资源和自然资源（泛资源）优势的股票，实现基金净值增长，以求持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采用"自下而上"结合"自上而下"的投资策略，通过股票选择、行业配置，结合自上而下的战术性大类资产配置策略，进行积极投资管理。
业绩比较基准	60%×沪深300指数＋40%×上证国债指数
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高等风险品种，预期风险和收益高于债券型、货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	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	16,686,071.27
2.本期利润	66,476,617.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.1610
4.期末基金资产净值	1,106,183,060.90
5.期末基金份额净值	2.673

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。

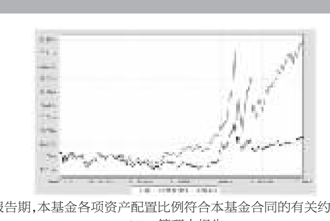
3.2 基金净值表现

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	6.54%	0.82%	2.85%	0.36%	3.69%	0.46%

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

新华泛资源优势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
(2009年7月13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		
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、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-08-03	–	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、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华策略精选股票型证券投资基金基金经理助理、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、新华泛资源优势灵活配置混合型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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，新华基金管理股份有限公司作为新华泛资源优势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》、《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其他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3季度，市场震荡上扬，上证主板走势好于创业板，有色金属、钢铁、煤炭、银行、食品饮料、通信、建材等周期板块走势较好，传媒、电力及公用事业、纺织服装等板块走势最差。3季度上证综指上涨4.9%，创业板指上涨2.69%，沪市300上涨4.63%，新华泛资源基金上涨6.54%，表现较好，基金3季度减持了部分中小创个股，加仓了部分低估值周期股，地产白马、化工、农业增持较多，仓位中性，基金持股集中度仍然较高，板块配置方面，重点配置了农林牧渔、化工、房地产、建筑装饰、国防军工等板块。

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2.673元，本报告期份额净值增长率为6.54%，同期比较基准的增长率为2.85%。

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2017年4季度指数震荡整理。目前市场情绪比较稳定，主题持续炒作，轮动较快，不易把握，4季度是政策主题高峰期，重点关注12月中央经济工作会议和农村工作会议的定调。4季度基金换手预计会比较低，坚守低估值个股，同时配置部分基本面较好的成长股。主题投资重点关注农业，对涨价题材板块谨慎，预计4季度保持中性仓位。

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	786,695,611.48	70.46
	其中：股票	786,695,611.48	70.46
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	134,551,465.37	12.05
7	其他各项资产	195,273,191.34	17.49
8	合计	1,116,520,268.19	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	57,307,770.12	5.18
B	采矿业	44,566,560.20	4.03
C	制造业	404,585,009.21	36.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	66,691,156.90	6.03
F	批发和零售业	30,143,220.83	2.72
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	38,579,117.42	3.49
J	金融业	35,976,636.27	3.25
K	房地产业	97,914,729.62	8.85
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	7,415,478.15	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	193,743.00	0.02
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	3,150,224.42	0.28
S	综合	–	–
	合计	786,695,611.48	71.12

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	600873	梅花生物	8,900,000	56,960,000.00	5.15
2	601952	苏垦农发	3,817,525	56,232,143.25	5.08
3	600760	中航黑豹	1,568,840	52,791,466.00	4.77
4	600383	金地集团	4,141,300	47,500,711.00	4.29
5	002146	荣盛发展	4,479,452	42,823,561.12	3.87
6	600691	阳煤化工	10,429,382	40,466,002.16	3.66
7	600598	北大荒	3,082,331	36,772,208.83	3.32
8	002368	太极股份	1,160,386	32,131,088.34	2.90
9	000666	经纬纺机	1,538,600	31,233,580.00	2.82
10	002036	联创电子	997,200	20,681,928.00	1.87

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

本报告期末本基金无贵金属投资。

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

本报告期末本基金无股指期货投资。

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 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	928,466.12
2	应收证券清算款	190,351,428.23
3	应收股利	–
4	应收利息	539,107.34
5	应收申购款	3,454,189.65
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	195,273,191.34

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	417,871,646.29
报告期基金总申购份额	113,362,699.85
减：报告期基金总赎回份额	117,409,477.31
报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	413,824,868.83

§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未持有本基金。

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

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	20170707-20170928	82,721,307.20	0.00	0.00	82,721,307.20	20.03%
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。							

8.2 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) 中国证监会批准新世纪泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二) 关于申请募集新世纪泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(三)中国证监会关于核准新世纪基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

(四)《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(五)《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(六)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(七)更新的《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(八)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(九)基金托管人业务资格批件及营业执照

(十)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

新华活期添利货币市场基金

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：平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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	4,132,827,123.25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	新华活期添利E
下属分级基金的交易代码	000903	003264	005148
报告期末下属分级基金的份额总额	3,136,200,638.88份	993,029,308.82份	3,597,175.55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)		
	新华活期添利	新华活期添利B	新华活期添利E
1.本期已实现收益	20,742,895.61	9,262,192.26	6,886.73
2.本期利润	20,742,895.61	9,262,192.26	6,886.73
3.期末基金资产净值	3,136,200,638.88	993,029,308.82	3,597,175.55

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.本基金本报告期于2017年9月7日新增E类（基金代码005148）。

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	1.0609%	0.0006%	0.3408%	0.0000%	0.7201%	0.0006%

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	1.1211%	0.0006%	0.3408%	0.0000%	0.7803%	0.0006%

3.新华活期添利E：

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	0.2725%	0.0026%	0.0888%	0.0000%	0.1837%	0.0026%

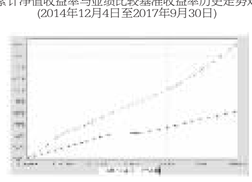
注：本基金本报告期于2017年9月7日新增E类（基金代码005148）。

本基金利润分配是按日结转份额。

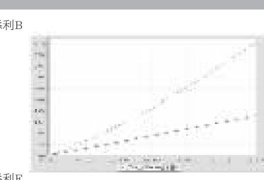
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华活期添利货币市场基金
份额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9月30日)

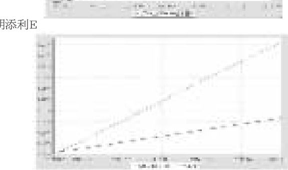
1.新华活期添利



2.新华活期添利B



3.新华活期添利E



注：本基金本报告期于2017年9月7日新增E类（基金代码005148）。
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		
王滨	本基金基金经理，固定收益与平衡投资部副总监、新华壹诺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、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。	2017-07-26	–	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，民生加银基金管理有限公司基金经理。2016年6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部副总监、新华壹诺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。
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，新华壹诺宝货币市场基金基金经理。	2015-07-10	2017-07-27	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。
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	2017-07-27	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，先后负责宏观研究、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，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。

本报告期内，本基金规模稳步增长，本基金依然秉持稳健投资原则谨慎操作，以确保组合安全性为首要任务，保障组合充足流动性，同时根据规模及配置时点合理调整各类资产配置比例，在提供充分流动性保证的情况下为持有人获取了较好的投资回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内A类（000903）基金份额净值收益率为1.0609%，同期业绩比较基准收益率为0.3408%；B类（003264）基金份额净值收益率为1.1211%，同期业绩比较基准收益率为0.3408%；E类（005148）基金份额净值收益率为0.2725%，同期业绩比较基准收益率为0.0888%。

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，我们认为宏观经济短期内韧性较强，监管去杠杆政策效果已有所显现，后续推进或更为温和，货币政策将维持稳健中性。总体来看，债券市场经历长时间调整后绝对收益率水平相对提高，中短端配置价值较高，不过受内外部基本面及资金面制约，短期内长端收益率呈现趋势性下行的概率不大。

本基金在投资策略上将结合市场表现与流动性要求，采取较为灵活的策略应对收益率变化，重点把握资金面波动时点，投向存款、存单、回购和短融等，在提供充分的流动性保证的情况下为持有人获取更好的投资回报。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报未连续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伍仟万的情形。

§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	固定收益投资	3,500,870,481.86	77.47
	其中：债券	3,500,870,481.86	77.47
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	191,650,000.00	4.24
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	724,445,326.07	16.03
4	其他资产	102,043,011.97	2.26
5	合计	4,519,008,819.90	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	15.59	
	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	382,878,785.68	9.26
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

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	7.16	9.27
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天（含）—60天	7.70	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天（含）—90天	34.31	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天（含）—120天	16.31	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天（含）—397天（含）	41.42	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	106.91	9.27

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	209,329,560.63	5.07
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	3,291,540,921.23	79.64
8	其他	–	–
9	合计	3,500,870,481.86	84.71
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	111719218	17恒丰银行CD218	1,500,000.00	148,016,561.02	3.58
2	179935	17贴现国债35	1,000,000.00	99,818,627.00	2.42
3	111782975	17大连银行CD148	1,000,000.00	99,437,618.67	2.41
4	111783301	17甘肃银行CD130	1,000,000.00	99,369,828.13	2.40
5	111799038	17成都银行CD097	1,000,000.00	99,204,652.92	2.40
6	111784360	17西安银行CD027	1,000,000.00	99,136,940.34	2.40
7	111784883	17中原银行CD268	1,000,000.00	99,134,465.59	2.40
8	111784574	17乌鲁木齐银行CD041	1,000,000.00	99,124,115.43	2.40
9	111784765	17廊坊银行CD093	1,000,000.00	99,102,036.47	2.40
10	111784759	17烟台银行CD023	1,000,000.00	99,082,508.75	2.40

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	0.1292%
报告期内偏离度的最低值	-0.0287%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0444%

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

报告期末本基金未持有资产支持证券。

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	7,844,959.18
4	应收申购款	94,198,052.79
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	102,043,011.97

5.9.4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，分项之和合计项之间可能存在尾差。

§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	新华活期添利E
本报告期期初基金份额总额	718,118,055.04	667,495,044.36	–
报告期基金总申购份额	4,870,560,433.32	804,438,528.22	3,598,175.91
报告期基金总赎回份额	–	478,904,263.76	1,000.36
报告期基金拆分变动份额	–	–	–
报告期期末基金份额总额	3,136,200,638.88	993,029,308.82	3,597,175.55

注：本基金本报告期于2017年9月7日新增E类（基金代码005148）。

§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
1	基金转换入	2017-09-27	22,029,897.39	30,225,644.89	0.00%
合计			22,029,897.39	30,225,644.89	

§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 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。

§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
二〇一七年十月二十六日

新华战略新兴产业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	新华战略新兴产业灵活配置混合
基金主代码	001294
交易代码	001294
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月29日
报告期末基金份额总额	347,152,537.76份
投资目标	重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会，综合运用多种投资策略，精选战略性新兴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绝对回报。
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战略性新兴产业发展状况的持续跟踪，以把握战略性新兴产业的实地调研、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战略性新兴产业为主题的优质股票进行投资。具体运作方法包括对战略性新兴产业界定、战略性新兴产业主题挖掘、战略性新兴产业个股挖掘等方法。债券投资策略主要运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、中小企业私募债券选择策略、收益率曲线骑乘策略以及可转换债券投资策略等。
业绩比较基准	70%*中证新兴产业指数+30%*中证综合债券指数
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	-3,223,572.72
2.本期利润	22,545,981.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0629
4.期末基金资产净值	304,737,794.00
5.期末基金份额净值	0.878

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。

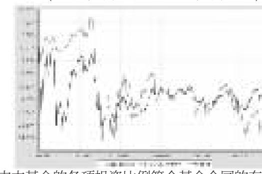
3.2 基金净值表现

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	7.86%	1.05%	4.92%	0.59%	2.94%	0.46%

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

新华战略新兴产业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
(2015年6月29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		
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，新华万银多元策略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，新华鑫盛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，新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-06-29	–	22	经济学硕士，历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、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、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华万银多元策略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、新华鑫盛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、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
付伟	本基金基金经理，新华优选成长混合型证券投资基金基金经理，新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理，新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理，新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-08-19	–	7	西安交通大学工学硕士，北京大学工商管理硕士，7年证券从业经验。历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理，新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与TMT组组长，先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。现任新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理、新华外延增长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战略新兴产业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》、《新华战略新兴产业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

三季度市场各板块表现比较均衡，风格呈现多样化，成长股在季度初大幅探底之后，逐渐震荡向上，开始表现出较好的投资机会。本基金保持较高仓位；配置方面，根据基金合同约定，主要投资于具有较高成长性的个股，包括电子、互联网、新能源汽车、军工，以及新兴消费等板块。未来将根据对市场的提前预判及时调整仓位配置，根据市场热点、成长性以及估值，精选主题和个股。

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0.878元，本报告期份额净值增长率为7.86%，同期比较基准的增长率为4.92%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观数据显示，国内经济运行平稳，央行定向降准使得流动性边际改善。海外方面，美国减税计划有望落地，小企业减负明显。在供给侧改革推进取得明显成效之后，预期政府将在经济结构转型升级、发展新兴产业方面出台一定的鼓励政策，这将提升市场的风险偏好。

未来更多关注市场的结构性机会，如国企改革、现代服务、军工、科技创新等板块。个股选择上，重点布局业绩稳健，估值处于较低水平，成长性良好的个股。

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	285,609,956.14	92.67
	其中：股票	285,609,956.14	92.67
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	19,415,638.54	6.30
7	其他各项资产	3,185,001.16	1.03
8	合计	308,210,595.84	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	4,424,240.22	1.45
B	采矿业	2,739,793.60	0.90
C	制造业	148,799,166.45	48.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	10,495,000.00	3.44
F	批发和零售业	5,829,425.69	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	7,770,257.21	2.55
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,854,097.41	15.05
J	金融业	18,620,000.00	6.11
K	房地产业	4,250,000.00	1.39
L	租赁和商务服务业	2,441,324.72	0.80
M	科学研究和技术服务业	815,307.88	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	51,243.66	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	2,200,000.00	0.72
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.04
R	文化、体育和娱乐业	31,173,705.87	10.23
S	综合	–	–
	合计	285,609,956.14	93.72

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	603728	鸣志电器	620,019	15,884,886.78	5.21
2	000800	一汽轿车	1,000,013	13,760,178.88	4.52
3	600760	中航黑豹	350,000	11,777,500.00	3.86
4	300251	光线传媒	1,000,000	10,940,000.00	3.59
5	002594	比亚迪	150,000	10,245,000.00	3.36
6	002861	瀛通通讯	260,064	9,747,198.72	3.20
7	601952	苏垦农发	660,000	9,721,800.00	3.19
8	000779	三毛派神	617,194	9,251,738.06	3.04
9	603929	亚翔集成	360,000	9,000,000.00	2.95
10	300188	美亚柏科	500,042	8,745,734.58	2.87

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

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	170,228.68
2	应收证券清算款	2,865,713.63
3	应收股利	–
4	应收利息	4,468.83
5	应收申购款	144,590.02
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,185,001.16

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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

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	369,863,733.18
报告期基金总申购份额	1,936,064.73
减：报告期基金总赎回份额	24,647,260.15
报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	347,152,537.76

§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未持有本基金。

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未持有本基金。

§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战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

（二）关于申请募集新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

（三）《新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（四）《新华战略新兴产业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《新华战略新兴产业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

（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