

新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

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

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代表其未来表现。投资者有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

Table with 2 columns: Item, Value. Summary of fund performance and key indicators.

Table with 2 columns: Item, Value. Financial indicators and performance metrics.

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。

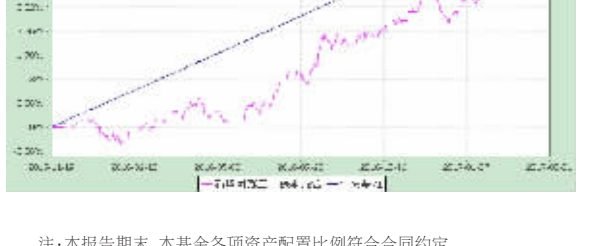
2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金申购费赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: Item, Value. Performance comparison metrics.

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



新华阿鑫二号保本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11月19日至2017年3月31日)



注:本报告期末,本基金各项资产配置比例符合合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: Name, Position, Start Date, End Date. List of fund managers.

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阿鑫二号保本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》、《新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金合同》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。

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管理制度指导意见》(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》。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 2017年一季度,在基建与地产投资及相关产业链复苏的推动下,经济企稳回升,很多传统行业盈利大幅改善,对于旧经济动能的持续性,我们在密切关注。通胀水平温和,金融杠杆政策持续,资金面较去年有边际改善。资产配置方面,我们根据安全垫厚度,从控制组合总体风险出发,把组合的风险暴露维持在可控水平。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.048元,本报告期份额净值增长率为1.95%,同期业绩比较基准为0.92%。

4.6 报告期内基金的投资策略和运作分析 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.048元,本报告期份额净值增长率为1.95%,同期业绩比较基准为0.92%。

4.7 报告期内基金的投资策略和运作分析 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.048元,本报告期份额净值增长率为1.95%,同期业绩比较基准为0.92%。

4.8 报告期内基金的投资策略和运作分析 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.048元,本报告期份额净值增长率为1.95%,同期业绩比较基准为0.92%。

4.9 报告期内基金的投资策略和运作分析 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.048元,本报告期份额净值增长率为1.95%,同期业绩比较基准为0.92%。

4.10 报告期内基金的投资策略和运作分析 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.048元,本报告期份额净值增长率为1.95%,同期业绩比较基准为0.92%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: Item, Amount, Percentage. Industry breakdown of stock investments.

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: Code, Industry, Amount, Percentage. Domestic stock investment breakdown.

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: Code, Name, Quantity, Fair Value, Percentage. Top 10 stock holdings.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: Code, Name, Quantity, Fair Value. Bond investment breakdown.

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

Table with 5 columns: Code, Name, Quantity, Fair Value, Percentage. Top 5 bond holdings.

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

Table with 5 columns: Code, Name, Quantity, Fair Value, Percentage. Top 10 asset-backed securities.

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

Table with 5 columns: Code, Name, Quantity, Fair Value, Percentage. Top 5 precious metal investments.

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

Table with 5 columns: Code, Name, Quantity, Fair Value, Percentage. Top 5 warrant investments.

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投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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 本基金本报告期末未持有国债期货投资。

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投资。

5.11 投资组合报告附注 5.11.1 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.11.2 本基金报告期内未持有贵金属投资。

5.11.3 本基金报告期内未持有权证投资。

5.11.4 本基金报告期内未持有股指期货投资。

5.11.5 本基金报告期内未持有国债期货投资。

5.11.6 本基金报告期内未持有其他金融衍生品投资。

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。

注:本基金2015年11月19日合同生效,封闭期两年,至2017年3月31日本基金处于封闭期。

新华丰盈回报债券型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31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代表其未来表现。投资者有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

Table with 2 columns: Item, Value. Summary of fund performance and key indicators.

Table with 2 columns: Item, Value. Financial indicators and performance metrics.

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。

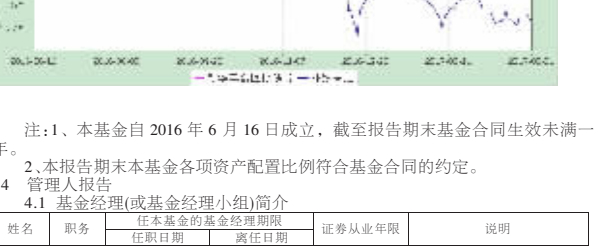
2.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金申购费赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: Item, Value. Performance comparison metrics.

3.2 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3月31日)



注:1.本基金自2016年6月16日成立,截至报告期末基金合同生效未满一年。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: Name, Position, Start Date, End Date. List of fund managers.

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。

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管理制度指导意见》(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》。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.027元,本报告期份额净值增长率为1.88%,同期业绩比较基准的增长率为-0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 本基金短期平稳,长期下行压力不容忽视,流动性紧张、汇率管制、去杠杆未完,利率政策调整谨慎,整体流动性呈现平衡态势。长期利率债继续调整,不过跌幅较去年四季度明显缩小。其中国债、国开债、10年期品种分别上行27BP和38BP,曲线平坦化上行。信用债方面,信用利差整体呈现上行趋势,其中短端利差走阔更为明显。

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.027元,本报告期份额净值增长率为1.88%,同期业绩比较基准的增长率为-0.69%。

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.027元,本报告期份额净值增长率为1.88%,同期业绩比较基准的增长率为-0.69%。

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.027元,本报告期份额净值增长率为1.88%,同期业绩比较基准的增长率为-0.69%。

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.027元,本报告期份额净值增长率为1.88%,同期业绩比较基准的增长率为-0.69%。

4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.027元,本报告期份额净值增长率为1.88%,同期业绩比较基准的增长率为-0.69%。

4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.027元,本报告期份额净值增长率为1.88%,同期业绩比较基准的增长率为-0.69%。

Table with 4 columns: Code, Industry, Amount, Percentage. Industry breakdown of stock investments.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Code, Industry, Amount, Percentage. Domestic stock investment breakdown.

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: Code, Name, Quantity, Fair Value, Percentage. Top 10 stock holdings.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: Code, Name, Quantity, Fair Value. Bond investment breakdown.

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

Table with 5 columns: Code, Name, Quantity, Fair Value, Percentage. Top 5 bond holdings.

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

Table with 5 columns: Code, Name, Quantity, Fair Value, Percentage. Top 10 asset-backed securities.

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

Table with 5 columns: Code, Name, Quantity, Fair Value, Percentage. Top 5 precious metal investments.

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

Table with 5 columns: Code, Name, Quantity, Fair Value, Percentage. Top 5 warrant investments.

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投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策 本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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 本基金本报告期末未持有国债期货投资。

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投资。

5.11 投资组合报告附注 5.11.1 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.11.2 本基金报告期内未持有贵金属投资。

5.11.3 本基金报告期内未持有权证投资。

5.11.4 本基金报告期内未持有股指期货投资。

5.11.5 本基金报告期内未持有国债期货投资。

5.11.6 本基金报告期内未持有其他金融衍生品投资。

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。

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

新华基金管理股份有限公司 二〇一七年四月二十一日