

新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

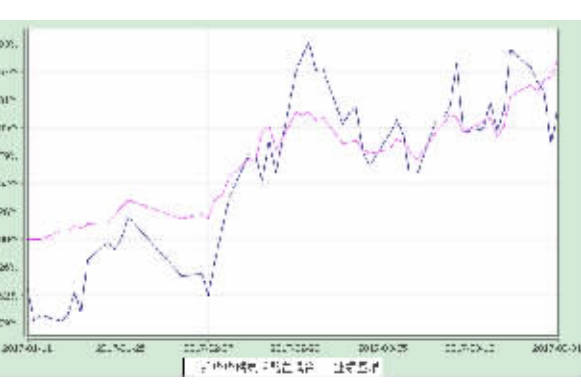
2017年3月31日

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
重要提示:基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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。

基金管理人新华基金管理股份有限公司
基金托管人中国银行股份有限公司
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

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年1月1日至2017年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, etc.

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



注:1.本基金于2017年01月11日基金合同生效,至本报告期末未逾一年;
2.本基金建仓期为6个月,本报告期末基金未完成建仓。

4 基金管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers like 张永刚 and 崔建波.

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华瑞灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人,按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华华瑞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。

4.3 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03月31日,本基金份额净值为1.0168元,本报告期基金份额净值增长率为1.68%,同期业绩比较基准的增长率为1.23%。

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
预计二季度市场将继续维持震荡,存在结构性行情。

4.6 报告期内基金管理人及基金托管人履行各自职责的情况
本报告期,新华基金管理股份有限公司作为新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人,按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华华瑞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。

4.7 影响投资者决策的其他重要信息
本基金本报告期末没有影响投资者决策的其他重要信息。

4.8 备查文件目录
(一)中国证监会批准新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
(二)《新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Lists assets like 权益投资, 固定收益投资, etc.

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

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists sectors like 农林牧渔, 采矿业, etc.

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

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(%). Lists stocks like 长江电力, 工商银行, etc.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bond types like 国债, 央行票据, etc.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists bonds like 16南航集SCP002, etc.

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

本基金本报告期末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

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货交易投资策略
根据本基金基金合同,本基金尚无国债期货交易政策。

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。

5.11 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》,查明华泰证券存在以下违法行为: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账户,对上述账户,华泰证券未按要求采取客户交易终端信息,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,未采取可操作措施,记录与客户身份识别有关的信息,证监会对华泰证券予以警告,没收违法所得1823827.00元并处以5470825.00元。

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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

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
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 单位:份, 基金合同生效日基金份总额, 基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额, etc.

5.7 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

Table with 3 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者名称, 期初份额, 申购份额, 持有份额, 份额占比.

5.8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
(二)《新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

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万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人,按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华万银多元策略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。

4.3 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03月31日,本基金份额净值为1.005元,本报告期基金份额净值增长率为0.70%,同期业绩比较基准的增长率为2.74%。

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

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists sectors like 农林牧渔, 采矿业, etc.

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

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(%). Lists stocks like 长江电力, 工商银行, etc.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bond types like 国债, 央行票据, etc.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists bonds like 16南航集SCP002, etc.

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

本基金本报告期末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

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货交易投资策略
根据本基金基金合同,本基金尚无国债期货交易政策。

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。

5.11 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》,查明华泰证券存在以下违法行为: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账户,对上述账户,华泰证券未按要求采取客户交易终端信息,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,未采取可操作措施,记录与客户身份识别有关的信息,证监会对华泰证券予以警告,没收违法所得1823827.00元并处以5470825.00元。

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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

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
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 单位:份, 基金合同生效日基金份总额, 基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额, etc.

5.7 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

Table with 3 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者名称, 期初份额, 申购份额, 持有份额, 份额占比.

5.8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
(二)《新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

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万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人,按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华万银多元策略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。

4.3 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03月31日,本基金份额净值为1.005元,本报告期基金份额净值增长率为0.70%,同期业绩比较基准的增长率为2.74%。

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

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists sectors like 农林牧渔, 采矿业, etc.

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

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(%). Lists stocks like 长江电力, 工商银行, etc.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists bond types like 国债, 央行票据, etc.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists bonds like 16南航集SCP002, etc.

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

本基金本报告期末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

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货交易投资策略
根据本基金基金合同,本基金尚无国债期货交易政策。

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。

5.11 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》,查明华泰证券存在以下违法行为: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账户,对上述账户,华泰证券未按要求采取客户交易终端信息,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,未采取可操作措施,记录与客户身份识别有关的信息,证监会对华泰证券予以警告,没收违法所得1823827.00元并处以5470825.00元。

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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

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
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.6 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 单位:份, 基金合同生效日基金份总额, 基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额, etc.

5.7 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

Table with 3 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者名称, 期初份额, 申购份额, 持有份额, 份额占比.

5.8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
(二)《新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

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万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人,按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华万银多元策略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。

4.3 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03月31日,本基金份额净值为1.005元,本报告期基金份额净值增长率为0.70%,同期业绩比较基准的增长率为2.74%。