

新华科技创新主题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:中国建设银行股份有限公司

重要提示:基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年4月20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。

本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (新华科技创新主题灵活配置混合, 002272, etc.)

主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (主要财务指标) and Value (报告期 (2017年1月1日至2017年3月31日) -463,331.97, etc.)

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

Table with 6 columns: Item (阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④) and Value (过去三个月 0.40%, 0.36%, 2.59%, 0.39%, -2.19%, -0.03%, etc.)

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的比较

新华科技创新主题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 (2016年3月22日至2017年3月31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规定。

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: Name (姓名), Position (职务), Tenure (任本基金的基金经理期限), and Description (说明)

4.2 管理人对于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科技创新主题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》、《新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金合同》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 公平交易专项说明

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》。

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。场外交易,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。

场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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业绩表现说明 本产品在一季度顺势提高仓位,捕捉了市场的一些机会,净值表现平稳。

4.4.2 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0.993元,本报告期份额净值增长率为0.40%,同期比较基准的增长率为2.59%。

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 未来市场预期区间震荡,结构性机会较多,操作上,提前布局稳健个股。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 本报告期末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: Item (序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)) and Value (1 权益投资 146,256,343.03 72.84, 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: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), and Proportion (占基金资产净值比例(%))

5.2.2 报告期末按行业分类的境外股票投资组合

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), and Proportion (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 6 columns: Item (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。

5.11 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

Table with 3 columns: Item (序号, 名称, 金额(元)) and Value (1 存出保证金 21,435.58, etc.)

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。

5.12 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: Item (本报告期初基金份额总额, 本报告期基金份额总额) and Value (150,247,634.85, 150,247,634.85, etc.)

5.13 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。

5.14 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

Table with 6 columns: Investor Type (投资者类别), Serial Number (序号), Holding Proportion (持有基金份额比例), Start Date (期初份额), End Date (期末份额), Proportion (持有份额), and Ratio (份额占比)

新华丰利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、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年4月18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。

本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (新华丰利债券, 003221, etc.)

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: Item (主要财务指标) and Value (报告期 (2017年1月1日至2017年3月31日) 1,705,661.63, etc.)

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

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;

3.2.2 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3月31日)

1.新华丰利债券 A:

Table with 6 columns: Item (阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④) and Value (过去三个月 0.83%, 0.05%, -0.69%, 0.09%, 1.52%, -0.04%, etc.)

2.新华丰利债券 C:

Table with 6 columns: Item (阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④) and Value (过去三个月 0.72%, 0.05%, -0.69%, 0.09%, 1.41%, -0.04%, etc.)

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3月31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、本基金建仓期为6个月,本报告期,本基金处于建仓期。

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、本基金建仓期为6个月,本报告期,本基金处于建仓期。

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: Name (姓名), Position (职务), Tenure (任本基金的基金经理期限), and Description (说明)

4.2 管理人对于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基金管理人按照《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 公平交易专项说明

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》。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

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。场外交易,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。

水平。股票方面,我们降低了绝对估值水平偏低但缺乏可持续性的行业和公司持仓,适当增加了估值合理、业绩成长性较高的标的;债券方面,我们仍维持中长期组合,并密切关注长期债券投资与交易机会的显现;转债方面,我们积极参与一级申购,但尚未进行二级市场投资。

4.4.2 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A类份额净值为1.0104元,本报告期份额净值增长率为0.83%,同期比较基准的增长率为-0.69%;本基金C类份额净值为1.0086元,本报告期份额净值增长率为0.72%,同期比较基准的增长率为-0.69%。

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2017年二季度,经济增速的脉冲效应仍在,通胀水平大概率保持温和,这给金融调控提供了政策空间。来自海外的不确定因素目前难给出确定的方向性答案,为此,我们会密切跟踪海外政治与经济态势,并评估对国内经济与金融环境的影响。

股票方面,我们会立足于宏观经济与微观主体的基本面,选择质地优良、估值合理的标的进行配置。基建投资的相关标的近期受到资金偏好,对此我们认为应保持适度谨慎。基建投资的边际回报率在降低,短期业绩难以代表长期业绩的基建投资策略应限于可持续业绩而不超越下一两年的业绩。我们更看好与衣食住行和医疗相关的传统行业,以及代表未来经济发展方向的蓝海领域,虽然鱼龙混杂,但仍值得多花时间与精力去发掘高成长标的。

债券方面,目前的长期收益率水平尚未对实体经济产生不良影响,向下压力不大,而大量发行的同业存单表明金融体系杠杆水平仍不低,因此我们对中长期利率保持谨慎,但会密切关注影响因素和收益率自身的变化。转债供给有望逐渐增加,如果能够显著压降低估值转债,则其投资价值值得关注。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 本报告期末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: Item (序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)) and Value (1 权益投资 57,324,785.26 9.65, 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: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), and Proportion (占基金资产净值比例(%))

5.2.2 报告期末按行业分类的境外股票投资组合

Table with 4 columns: Code (代码), Industry (行业类别), Fair Value (公允价值(元)), and Proportion (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 6 columns: Item (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。

5.11 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

Table with 3 columns: Item (序号, 名称, 金额(元)) and Value (1 存出保证金 37,001.75, etc.)

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。

5.12 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: Item (本报告期初基金份额总额, 本报告期基金份额总额) and Value (399,638,652.28, 399,638,652.28, etc.)

5.13 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。

5.14 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

Table with 6 columns: Investor Type (投资者类别), Serial Number (序号), Holding Proportion (持有基金份额比例), Start Date (期初份额), End Date (期末份额), Proportion (持有份额), and Ratio (份额占比)