新华灵活主题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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华灵活主题混合
基金主代码	519099
交易代码	519099
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 7 月 13 日
报告期末基金份额总额	37,406,348.12 份
投资目标	以主题投资为核心,前瞻性挖掘市场的长期主题趋势,动态把握市场阶段性的主题转换,并精选获益程度高的主题个股进行投资,在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续、稳定增长。
投资策略	本基金以战略性与战术性资产配置策略为指导,围绕市场的长期性和阶段性投资主题进行动态配置,并精选获益程度最高的主题个股群进行重点投资。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率 + 20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金资产整体的预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金,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	中信银行股份有限公司

§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 1 月 1 日-2017 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	327,810.25
2.本期利润	-858,271.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0265
4.期末基金资产净值	48,214,211.24
5.期末基金份额净值	1.289

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	-2.13%	0.87%	3.58%	0.41%	-5.71%	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

新华灵活主题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
(2011 年 7 月 13 日至 2017 年 3 月 31 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		
李会忠	本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华积极价值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,新华鑫动力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。	2015-06-11	-	10	经济学硕士,10 年证券从业经验。2007 年 9 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行业研究员、策略分析师、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华积极价值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、新华鑫动力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。

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灵活主题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》、《新华灵活主题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

2017 年一季度,市场稳中有升,热点板块不断轮换,家电、食品饮料、煤炭、银行、建材、交通运输等板块涨幅居前,产品净值表现平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 3 月 31 日,本基金份额净值为 1.289 元,本报告期份额净值增长率为-2.13%,同期比较基准的增长率为 3.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计接下来市场不断有热点切换,京津冀、雄安、军工、环保、一带一路等板块可能存在机会,我们将保持密切关注。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金从 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 2 月 21 日连续三十一个工作日基金资产净值低于五千万元。

§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	44,804,157.94	92.10
	其中:股票	44,804,157.94	92.10
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	3,776,256.14	7.76
7	其他各项资产	67,171.74	0.14
8	合计	48,647,585.82	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	101,046.96	0.21
B	采矿业	478,770.65	0.99
C	制造业	21,286,579.12	44.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	233,253.67	0.48
E	建筑业	527,128.86	1.09
F	批发和零售业	2,935,411.70	6.09
G	交通运输、仓储和邮政业	83,810.86	0.17
H	住宿和餐饮业	95,182.87	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,607,373.95	28.22
J	金融业	925,093.61	1.92
K	房地产业	1,035,174.02	2.15
L	租赁和商务服务业	241,171.97	0.50
M	科学研究和技术服务业	490,831.21	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	643,075.15	1.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	213,188.23	0.44
R	文化、体育和娱乐业	1,238,726.90	2.57
S	综合	668,338.21	1.39
	合计	44,804,157.94	92.93

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	002279	久其软件	50,500	937,280.00	1.94
2	600390	*ST 金瑞	63,000	924,840.00	1.92
3	600760	中航黑豹	24,593	821,160.27	1.70
4	002174	游族网络	26,500	738,555.00	1.53
5	600520	*ST 中发	34,000	722,840.00	1.50
6	300078	思创医惠	25,200	599,760.00	1.24
7	002491	通鼎互联	40,500	597,780.00	1.24
8	300033	同花顺	9,377	594,126.72	1.23
9	300219	鸿利智汇	45,800	570,210.00	1.18
10	600850	华东电脑	24,404	570,077.44	1.18

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投资。

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权证。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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遣责、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	50,496.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	934.30
5	应收申购款	15,740.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,171.74

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	27,352,444.40
报告期基金总申购份额	13,565,731.34
减:报告期基金总赎回份额	3,511,827.62
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	37,406,348.12

§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	20170222-20170331	0.00	11,511,128.17	0.00	11,511,128.17	30.77%

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未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灵活主题混合型证券投资基金募集的文件
(二)关于申请募集新华灵活主题混合型证券投资基金之法律意见书
(三)《新华灵活主题混合型证券投资基金托管协议》
(四)《新华灵活主题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《新华灵活主题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
二〇一七年四月二十一日

新华鑫安保本一号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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 4 月 19 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华鑫安保本一号混合
基金主代码	519167
交易代码	519167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 18 日
报告期末基金份额总额	1,499,500,402.73 份
投资目标	综合运用投资组合保险策略,严格控制风险,在为投资人提供投资金额安全保证的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	在投资策略方面,本基金将主要采用可变比例组合保本策略(VPPI,Variable Proportion Portfolio Insurance)。在保本周期内,基金管理人将严格依据所选择的量化策略模型对固定收益资产和风险资产的配置比例进行动态优化调整,以达到保本和锁定部分收益的目的。同时,本基金管理人将依据与担保人或保本义务人签订的风险管理协议,对基金资产进行严格的风险控制并适时调整投资组合。
业绩比较基准	(一年期银行定期存款税后收益率+1%)×1.5。
风险收益特征	本基金为积极配置的保本混合型基金,属于证券投资基金当中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,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	中国农业银行股份有限公司
基金保证人	瀚华担保股份有限公司

§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 1 月 1 日-2017 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	20,053,189.22
2.本期利润	19,362,663.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0129
4.期末基金资产净值	1,533,456,877.37
5.期末基金份额净值	1.023

注:1.本期已实现收益指本期利息收入、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	1.29%	0.10%	0.93%	0.01%	0.36%	0.09%

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

新华鑫安保本一号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
(2014 年 6 月 18 日至 2017 年 3 月 31 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。

3.3 其他指标

本基金本报告期无其他指标披露。

§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		
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。	2016-05-25	-	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。

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鑫安保本一号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》、《新华鑫安保本一号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

2017 年一季度,债券市场呈现窄幅震荡走势,资金面波动明显加大,一是由于经济基本面呈现出持续改善趋势,二是美国经济持续走强致使美联储持续加息预期增强,三是央行金融去杠杆防风险政策思路明确。权益市场继续区间内震荡,传统白马及各行业龙头个股有较好的相对收益。

本报告期内,本基金以谨慎操作积累安全垫为主要思路。债券投资上,以中短久期高评级债券进行配置获取稳定持有收益。同时在权益市场中寻找相对较为稳健的低估值、具有安全边际的价值股配置,并且参与新股和可转债 IPO 增厚收益,取得了相对较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 3 月 31 日,本基金份额净值为 1.023 元,本报告期份额净值增长率为 1.29%,同期比较基准的增长率为 0.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,我们认为经济受益于传统周期行业盈利持续改善有望继续回升。同时由于大宗商品价格制约,叠加监管去杠杆政策取向,货币政策预计维持中性格局。总体来看,债券市场在经历大幅上行后风险调整后收益相对提高,但受内外部基本面及政策面制约,预计短期趋势下行概率不大。权益市场中经历史验证业绩稳定增长的白马个股以及基本面触底反转的行业龙头将是本基金未来重点关注对象。

具体操作上,本基金将继续以债券配置为主,根据保本期限未来依然短久期高评级为主。权益方面根据安全垫比率进行更加积极的配置,同时参与一级新股及转债申购,在保证组合安全性的基础上为持有人创造更高的投资收益。

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伍仟万元的情形。

§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	160,015,805.31	10.41
	其中:股票	160,015,805.31	10.41
2	固定收益投资	1,299,147,043.00	84.52
	其中:债券	1,299,147,043.00	84.52
	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	40,000,180.00	2.60
	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	24,187,013.30	1.57
7	其他各项资产	13,799,293.53	0.90
8	合计	1,537,149,335.14	100.00

注:由于四舍五入原因,分项与合计项存在尾差。

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	5,987,710.00	0.39
C	制造业	80,310,653.89	5.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,568,740.00	1.15
E	建筑业	388,013.92	0.03
F	批发和零售业	5,824,408.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	5,133,152.28	0.33
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	14,423,043.62	0.94
K	房地产业	24,561,401.60	1.60
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	2,896,892.00	0.19
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	2,921,790.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	160,015,805.31	10.43

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	600863	内蒙华电	5,244,400	17,568,740.00	1.15
2	001979	招商蛇口	846,741	14,902,641.60	0.97
3	002250	联化科技	480,900	7,564,557.00	0.49
4	000807	云铝股份	892,300	6,513,790.00	0.42
5	600352	浙江龙盛	639,600	6,012,240.00	0.39
6	601328	交通银行	827,532	5,155,524.36	0.34
7	601006	大秦铁路	677,382	5,127,781.74	0.33
8	000729	燕京啤酒	669,400	5,020,500.00	0.33
9	600596	新安股份	500,976	5,019,779.52	0.33
10	600743	华远地产	1,071,800	4,865,972.00	0.32

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	14,577,428.00	0.95
5	企业短期融资券	270,546,000.00	17.64
6	中期票据	30,258,000.00	1.97
7	可转债(可交换债)	7,984,615.00	0.52
8	同业存单	975,781,000.00	63.63
9	其他	-	-
10	合计	1,299,147,043.00	84.72

注:因四舍五入,分项与合计项存在尾差。

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	111682549	16 包商银行 CD090	1,500,000	143,460,000.00	9.36
2	111794912	17 盛京银行 CD053	1,100,000	108,779,000.00	7.09
3	011698141	16 中海运 SCP004	800,000	80,216,000.00	5.23
4	111719051	17 恒丰银行 CD051	700,000	69,195,000.00	4.51
5	111680398	16 江苏江南农村商业银行 CD153	700,000	68,698,000.00	4.48

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

本基金本报告期无资产支持证券投资。

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

本基金报告期末无贵金属投资。

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

本基金本报告期无权证投资。

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

本基金报告期末无国债期货持仓。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期末无国债期货投资。

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遣责、处罚的情形。

5.11.2 本报告期内,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之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	284,825.58
2	应收证券清算款	17,874.24
3	应收股利	-
4	应收利息	13,496,593.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,799,293.53

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	181,615.00	0.01

5.11.5 报告期末前十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	600596	新安股份	5,019,779.52	0.33	重要事项未公告

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	1,499,500,402.73
报告期基金总申购份额	-
减:报告期基金总赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,499,500,402.73

§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

本基金报告期无基金管理人持有本基金份额的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金无基金管理人运用固有资金投资本基金交易的情况。

§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 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	20170101-20170331	450,051,593.73	0.00	0.00	450,051,593.73	30.01%

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未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)中国证监会核准新华鑫安保本一号混合型证券投资基金募集的文件
(二)《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》
(三)《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金托管协议》
(四)更新的《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书》
(五)关于申请募集新华鑫安保本一号混合型证券投资基金之法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照
(八)中国证监会要求的其他文件
(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
二〇一七年四月二十一日