

新华积极价值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:二〇一七年四月二十一日

51 重要提示 基金管理人、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。

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 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, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

Table with 6 columns: 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. Rows include 过去三个月, 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.

注:本报告期末本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Lists 李志强 and 李志强.

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 根据中国证监会《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《新华基金管理有限公司公平交易管理制度》。

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,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 管理人对于报告期内本基金资产净值变动情况的说明 本报告期,新华基金管理有限公司作为新华积极价值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》、《新华积极价值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。

54 基金投资组合报告 5.1 报告期末基金投资组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1 权益投资 (286,217,765.74), 2 固定收益投资, 3 贵金属投资, 4 金融衍生品投资, 5 买入返售金融资产, 6 银行存款和结算备付金合计, 7 其他各项资产, 8 合计 (309,207,867.74).

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(%). Rows include A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, D 电力、热力、燃气及水生产和供应业, E 建筑业, F 批发和零售业, G 交通运输、仓储和邮政业, H 住宿和餐饮业, I 信息技术, J 金融业, K 房地产业, 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, 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, S 综合, 合计.

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: 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(%). Rows include 1 600519 贵州茅台, 2 002195 三三四, 3 002555 三七互娱, 4 600520 \*ST中发, 5 600390 \*ST金瑞, 6 000651 格力电器, 7 002439 启明星辰, 8 002279 久其软件, 9 002491 通鼎互联, 10 300287 飞利信.

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合 本报告期末本基金无债券投资。 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 本报告期末本基金无债券投资。 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 本报告期末本基金无资产支持投资。 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。 5.11 投资组合报告附注 5.11.1 报告期内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 5 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1 存出保证金 44,325.36, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息 4,938.78, 5 其他应收款 30,811.51, 6 其他流动资产, 7 待摊费用, 8 其他资产, 9 合计 80,075.16.

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本报告期末本基金无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 本报告期末本基金前十名股票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。

86 开放式基金份额变动 单位:份 本报告期初基金份额总额 344,633,483.04 本报告期基金申购份额 1,135,203.60 本报告期基金赎回份额 22,201,709.92 本报告期末基金份额总额 323,566,976.72

87 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 本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

88 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 本基金本报告期内未有影响投资者决策的其他重要信息。 8.2 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 本基金本报告期内未有影响投资者决策的其他重要信息。

89 备查文件目录 9.1 备查文件目录 (一)中国证监会批准新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金募集的文件 (二)关于申请募集新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书 (三)新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议 (四)新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同 (五)《新华基金管理有限公司开放式基金业务规则》 (六)更新的《新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》 (七)基金托管人业务资格证件、营业执照及公司章程 (八)基金托管人业务资格证件及营业执照 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询。

新华基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日

新华安享惠金定期开放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:新华基金管理有限公司 基金托管人:广发银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

51 重要提示 基金管理人、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。

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 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, 4.期末基金资产净值, 5.期末基金份额净值.

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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

Table with 6 columns: 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. Rows include 过去三个月, 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.

注:本报告期末本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

84 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Lists 于洋 and 于洋.

4.2 管理人对于报告期内本基金资产净值变动情况的说明 本报告期,新华基金管理有限公司作为新华安享惠金定期开放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》、《新华安享惠金定期开放债券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,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 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,新华基金管理有限公司作为新华安享惠金定期开放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》、《新华安享惠金定期开放债券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。

4.5 公平交易专项说明 4.5.1 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《新华基金管理有限公司公平交易管理制度》。

4.5.2 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。

4.6 管理人对于报告期内本基金资产净值变动情况的说明 本报告期,新华基金管理有限公司作为新华安享惠金定期开放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》、《新华安享惠金定期开放债券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。

4.7 公平交易专项说明 4.7.1 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《新华基金管理有限公司公平交易管理制度》。

4.7.2 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。

4.8 管理人对于报告期内本基金资产净值变动情况的说明 本报告期,新华基金管理有限公司作为新华安享惠金定期开放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》、《新华安享惠金定期开放债券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。

4.9 公平交易专项说明 4.9.1 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《新华基金管理有限公司公平交易管理制度》。

4.9.2 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。

新华基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日

54 基金投资组合报告 5.1 报告期末基金投资组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 1 权益投资, 2 固定收益投资 (604,129,053.90), 3 贵金属投资 (604,129,053.90), 4 金融衍生品投资, 5 买入返售金融资产, 6 银行存款和结算备付金合计 (5,006,495.82), 7 其他各项资产 (13,077,023.35), 8 合计 (622,212,573.07).

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(%). Rows include A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, D 电力、热力、燃气及水生产和供应业, E 建筑业, F 批发和零售业, G 交通运输、仓储和邮政业, H 住宿和餐饮业, I 信息技术, J 金融业, K 房地产业, 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, 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, S 综合, 合计.

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: 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(%). Rows include 1 041669003 16 呈利石化 CP001, 2 011698710 16 前海 SCP001, 3 041635305 16 红日药业 CP001, 4 101466909 14 津航空 MTN001, 5 011698199 16 宏图高科 SCP003.

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国家债券, 2 央行票据, 3 金融债券, 4 企业债券 (132,607,477.80), 5 企业短期融资券 (420,793,000.00), 6 中期票据 (50,614,000.00), 7 可转债(可交换债) (114,576.10), 8 同业存单, 9 其他, 10 合计 (604,129,053.90).

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: 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(%). Rows include 1 041669003 16 呈利石化 CP001, 2 011698710 16 前海 SCP001, 3 041635305 16 红日药业 CP001, 4 101466909 14 津航空 MTN001, 5 011698199 16 宏图高科 SCP003.

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 本报告期末,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 本报告期末,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 本报告期末本基金无国债期货投资。 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 报告期内,本基金投资的前十名债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

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本报告期末本基金未持有可转换债券。 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本报告期末,本基金无受限情况。 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。

86 开放式基金份额变动 单位:份 本报告期初基金份额总额 168,086,798.05 本报告期基金申购份额 203,445,073.10 本报告期基金赎回份额 25,373,829.88 本报告期末基金份额总额 346,157,941.27

87 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 本报告期,本基金管理人未持有本基金。 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 本报告期内,本基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

88 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 本报告期末,本基金管理人未持有本基金。 8.2 影响投资者决策的其他重要信息 本报告期末,本基金管理人未持有本基金。

89 备查文件目录 9.1 备查文件目录 (一)中国证监会批准新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金募集的文件 (二)《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金合同》 (三)《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金托管协议》 (四)《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金合同》 (五)《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金业务规则》 (六)《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金招募说明书》 (七)基金托管人业务资格证件、营业执照及公司章程 (八)基金托管人业务资格证件及营业执照 (九)中国证监会行政许可申请材料及中国证监会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询。

新华基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日