新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

重要提示

新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会 2014 年 3 月 4 日证监许可[2014]243 号文核准注册。本基金合同已于 2014 年 4 月 16 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险,包括利率风险,信用风险,流动性风险,再投资风险,通货膨胀风险,操作或技术风险,合规性风险和其他风险。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金份额时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不对投资者保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2016 年 10 月 16 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日(财务数据未经会计师事务所审计)。

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

一 基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:新华基金管理股份有限公司
住所:重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼第 19 层
办公地址:北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座
重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼第 19 层
法定代表人:陈重
设立日期:2004 年 12 月 9 日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:证监基金字【2004】197 号
注册资本:贰亿壹仟柒佰伍拾万元人民币
联系人:齐岩
电话:(010)68779666
传真:(010)68779528
股权结构:

股东名称	出资额(万元人民币)	出资比例
恒泰证券股份有限公司	12,750	58.62%
新华信托股份有限公司	7,680	35.31%
杭州永原网络科技有限公司	1,320	6.07%
合 计	21,750	100%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

陈重先生:董事长,金融学博士。历任原国家经委中国企业管理协会研究部副主任、主任;中国企业报社社长;中国企业管理科学基金会秘书长;重庆市政府副秘书长;中国企业联合会常务副理事长;享受国务院特殊津贴专家。现任新华基金管理股份有限公司董事长。

张宗友先生:董事,硕士。历任内蒙古证券有限责任公司营业部经理、人事部经理;太平洋证券股份有限公司副总裁,分管经纪业务;恒泰证券股份有限公司副总裁,分管人力资源、信息技术、经纪业务等事务。现任新华基金管理股份有限公司总经理(持有子公司北京新华富时资产管理有限公司 1%股权)。

于芳女士:董事。历任北京市水利建设管理中心项目管理及法务专员、新时代证券有限责任公司总经理助理、副总经理。现任恒泰证券股份有限公司合规总监。

胡三明先生:董事,博士。曾就职于中国太平洋财产保险股份有限公司、泰康资产管理有限公司、合众资产管理有限公司、中英益利资产管理公司,历任泰康资产管理有限公司资产负债管理部组合经理、合众资产权益投资部高级投资经理、中英益利资产管理公司权益投资部总经理,现任恒泰证券股份有限公司投资总监。

胡波先生:独立董事,博士,历任中国人民大学财政金融学院教师、中国人民大学风险投资发展研究中心研究员、副主任、执行主任,现任中国人民大学财政金融学院副教授。

宋敏女士:独立董事,硕士,历任四川资阳市人民法院法官、中国电子系统工程总公司法务人员、北京市中济律师事务所执业律师,现任职于北京市东清律师事务所。

张贵龙先生:独立董事,硕士,历任陕西省临汾地区教育学院教师。现任职于北京大学财务部。

2、监事会成员

王海兵先生:监事会主席,学士。历任山西证券有限责任公司业务部副经理、山西天元会计师事务所审计部经理、长财证券经纪有限责任公司财务部副经理、财务总监、恒泰证券有限责任公司合规负责人、合规总监等职务,现任恒泰证券股份有限公司财务总监。

李会忠先生:职工监事,硕士。九年证券从业经验,历任新华基金管理股份有限公司投资管理部行业分析师。现任新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华灵活主题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、新华鑫益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、新华中证环保产业指数分级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。

别治女士:职工监事,金融学学士。九年证券从业经验,历任《每日经济新闻》、《第一财经日报》财经记者,新华基金媒体经理,现任新华基金总经理办公室主任助理。

3、高级管理人员情况

陈重先生:董事长,简历同上。

张宗友先生:总经理,简历同上。

徐端骞先生:副总经理,学士。历任上海君创财经顾问有限公司并购部经理、上海力矩产业投资管理有限公司并购部经理、新时代证券有限责任公司投行部项目经理,新华基金管理股份有限公司总经理助理兼运作保障部总监。现任新华基金管理股份有限公司副总经理。

晏益民先生:副总经理,学士。历任大通证券投行总部综合部副总经理,泰信基金机构理财部总经理,天治基金北京分公司总经理,天治基金总经理助理,新华基金总经理助理,现任新华基金管理股份有限公司副总经理。

齐岩先生:督察长,学士。历任中信证券股份有限公司解放北路营业部职员、天津管理部职员、天津大港营业部综合部经理,现任新华基金管理股份有限公司督察长兼任子公司北京新华富时资产管理有限公司董事(持有子公司 1%股权)。

崔建波先生:副总经理,经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、海融资讯系统有限公司研究员、和讯信息科技有限公司证券研究部、理财服务部经理、北方国际信托股份有限公司投资部信托高级投资经理、新华基金管理股份有限公司总经理助理。现任新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监、权益投资部总监、基金经理。

沈健先生:副总经理,硕士。历任嘉实基金管理有限公司机构客户部高级客户经理、海富通基金管理有限公司渠道副总监、天治基金管理有限公司市场总监、纽银梅隆西部基金管理有限公司渠道销售副总监、华商基金管理有限公司渠道业务部部门总经理,现任新华基金管理股份有限公司副总经理。

林艳芳女士:副总经理,学士。历任中国人民银行呼和浩特分行金融管理处副主任科员、内蒙古自治区证券公司证券交易部部门总经理、内蒙古自治区证券登记公司登记存管部部门总经理、内蒙古紫玉投资管理有限公司董事长兼总经理、恒泰证券有限责任公司经纪事业部总裁助理兼部门总经理、新时代证券有限责任公司副总经理、吉林省股权投资基金协会常务副会长兼秘书长、东北证券股份有限公司零售客户部总裁助理,现任新华基金管理股份有限公司副总经理、子公司北京新华富时资产管理有限公司董事长(薪酬从子公司领取)。

4、本基金基金经理人员情况

(1)历任基金经理:

贲兴振先生:管理本基金时间:2014 年 4 月 16 日—2015 年 5 月 20 日。

(2)现任基金经理

李会忠先生:职工监事,硕士。九年证券从业经验,历任新华基金管理股份有限公司投资管理部行业分析师。现任新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华灵活主题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、新华鑫益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、新华中证环保产业指数分级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。

崔建波先生:经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、海融资讯系统有限公司研究员、和讯信息科技有限公司证券研究部、理财服务部经理、北方国际信托股份有限公司投资部信托高级投资经理。现任新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监、权益投资部总监、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华策略精选股票型证券投资基金基金经理、新华优选分红混合型证券投资基金基金经理、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

5、投资管理委员会成员

主席:总经理张宗友先生;成员:副总经理兼投资总监、权益投资部总监崔建波先生、投资总监助理于泽雨先生、研究部总监张霖女士、金融工程部副总监李会忠先生、固定收益与平衡投资部总监姚秋先生、基金经理付伟先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二 基金托管人

1、基金托管人概况

名称:平安银行股份有限公司
住所:广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址:广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
法定代表人:孙建一
成立时间:1987 年 12 月 22 日
组织形式:股份有限公司
注册资本:14,308,676,139 元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可[2008]1037 号
联系人:潘琦
联系电话:(0755) 2216 8257

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行(深圳证券交易所简称“平安银行”,证券代码 000001),其前身深圳发展银行股份有限公司,于 2012 年 6 月吸收合并原平安银行并于同年 7 月更名为平安银行。中国平安保险(集团)股份有限公司及其子公司合计持有平安银行 59%的股份,为平安银行的控股股东。截至 2015 年末,平安银行在职员工 37,937 人,通过全国 54 家分行、997 家营业机构为客户提供多种金融服务。

截至 2015 年 12 月 31 日,平安银行资产总额 25,071.49 亿元,较年初增长 14.67%;各项存款余额 17,339.21 亿元,较年初增加 2,007.38 亿元,增幅 13.09%,增速居同业领先地位,市场份额稳步提升;各项贷款(含贴现)12,161.38 亿元,较年初增长 18.68%。2015 年平安银行实现营业收入 961.63 亿元,同比增长 31.00%;准备前营业利润 593.80 亿元,同比增长 43.93%;净利润 218.65 亿元,同比增长 10.42%;资本充足率 10.94%、一级资本充足率及核心一级资本充足率 9.03%,满足监管标准。

平安银行总行设资产托管事业部,下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT 系统支持处、督察合规处、外包业务中心 8 个处室,目前部门人员为 55 人。

2、主要人员情况

陈正涛,男,中共党员,经济学硕士、高级经济师、高级理财规划师、国际注册私人银行家,具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行工作,具有本外币资金清算,银行经营管理及基金托管业务的经营管理经验。1985 年 7 月至 1993 年 2 月在武汉金融高等专科学校任教;1993 年 3 月至 1993 年 7 月在招商银行武汉分行任客户经理;1993 年 8 月至 1999 年 2 月在招行武汉分行武昌支行任计划信贷部经理、行长助理;1999 年 3 月-2000 年 1 月在招行武汉分行青山支行任行长助理;2000 年 2 月至 2001 年 7 月在招行武汉分行公司银行部任副总经理;2001 年 8 月至 2003 年 2 月在招行武汉分行解放公园支行任行长;2003 年 3 月至 2005 年 4 月在招行武汉分行机构业务部任总经理;2005 年 5 月至 2007 年 6 月在招行武汉分行硚口支行任行长;2007 年 7 月至 2008 年 1 月在招行武汉分行同业银行部任总经理;自 2008 年 2 月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副总经理,一直负责公司银行产品开发与管理,全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作、营销和管理,尤其是对商业银行有关的各项监管政策比较熟悉。2011 年 12 月任平安银行资产托管部副总经理;2013 年 5 月起任平安银行资产托管事业部副总裁(主持工作);2015 年 3 月 5 日起任平安银行资产托管事业部总裁。

3、基金托管业务经营情况

2008 年 8 月 6 日获得中国证监会、中国银行业监督管理委员会核准开办证券投资基金托管业务。

截至 2016 年 6 月底,平安银行股份有限公司托管净值规模合计 4.75 万亿,托管证券投资基金共 43 只,具体包括华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安大华日增利货币市场基金、新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金、新华阿里一号保本混合型证券投资基金、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金、平安大华财富宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华财富金 30 天理财债券型证券投资基金、新华活期添利货币市场证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、鹏华安盈宝货币市场基金、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中海安鑫宝 1 号保本混合型证券投资基金、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、嘉合磐石混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金、鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金、博时裕泰纯债债券型证券投资基金、德邦增利货币市场基金、中海顺鑫保本混合型证券投资基金、民生加银新收益债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、广发安泽回报灵活配置混合型证券投资基金、博时裕景纯债债券型证券投资基金、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、嘉实稳丰债券型证券投资基金、嘉实稳盛债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金。

三 相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

名称:新华基金管理股份有限公司北京直销中心
办公地址:北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座
法定代表人:陈重
电话:010-68730999
联系人:王志强
公司网址: www.ncfund.com.cn
客服电话:400-819-8866
电子直销:新华基金网上交易平台
网址:https://trade.ncfund.com.cn

2、其他销售机构

(1)公司全称:上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址:上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼
法定代表人:其实
客服电话:400-1818-188
联系人:丁姗姗
公司网址:www.1234567.com.cn

(2)公司全称:浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼
法定代表人:凌顺平
联系人:林海明
客服电话:4008-773-772
公司网站:www.5ifund.com

(3)公司全称:众升财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08
法定代表人:李招娣
客服电话:400-059-8888
联系人:李艳
公司网站:www.wy-fund.com

(4)公司全称:蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 楼
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
客服电话:4000-766-123
公司网站:www.fund123.cn

(5)公司全称:北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012
法定代表人:赵荣春
客服电话:400-678-5095
联系人:盛海娟
公司网站:www.niuji.net

(6)公司全称:北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
办公地址:北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层
法定代表人:闫振杰
客服电话:400-8188-000
联系人:马林
公司网站:www.myfund.com

(7)公司全称:北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层
法定代表人:梁越
联系人:张晔
客服电话:4007-868-868
公司网站:www.chtfund.com

(8)公司全称:上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层
法定代表人:张跃伟
联系人:唐诗洋
客服电话:400-820-2899
公司网站: www.erichfund.com

(9)公司全称:北京增财基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号
办公地址:北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室
法定代表人:罗细安
联系人:张蕾
客服电话:400-001-8811
公司网站:www.zcvc.com.cn

(10)公司全称:一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702
办公地址:北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208
法定代表人:吴雪秀
联系人:刘栋栋
客服电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com

(11)公司全称:厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504
办公地址:厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504
法定代表人:林松
联系人:袁艳艳
客服电话:400-698-0777
公司网站:www.dkhs.com

(12)公司全称:诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室
办公地址:上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼
法定代表人:汪静波
联系人:张裕
客服电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com

(13)公司全称:深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#
办公地址:北京市西城区金融大街 35 号 国际企业大厦 C 座 9 层
法定代表人:杨懿
联系人:张燕
客服电话:400-166-1188
网址:8.jrj.com.cn

(14) 公司全称:上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼
法定代表人:杨文斌
联系人:胡凯隽
客服电话:400-700-9665
公司网址:www.howbuy.com

(15)公司全称:深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 层 IJ 单元
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
联系人:童彩平
公司网址:www.zlfund.cn,www.jjmmw.com

(16)公司全称:和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦
办公地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦
法定代表人:王莉
客服电话: 400-920-0022
联系人:魏亚斐
公司网站:licaike.hexun.com

(17)公司全称:宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809
办公地址:北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 180
法定代表人:沈伟桦
联系人:刘梦轩
客服电话:400-6099-200
公司网站:www.yixinfund.com

(18)公司全称:珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491
办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:钟琛
客服电话:020-89629066
公司网址:www.yingmi.cn

(19)公司全称:上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室
办公地址:上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼
法定代表人: 陈继武
联系人:葛佳蕊
客服电话:4000-178-000
网址:www.lingxianfund.com

(20)公司全称:北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址:北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603
办公地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层
法定代表人:董浩
联系人:于婷婷
客服电话:400-068-1176
网址:www.jimu.com

(21)公司全称:中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址:北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室
办公地址:北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区 A 座 5 层
法定代表人:彭运年
联系人:仲甜甜
客服电话:4008-909-998
网址:www.jnlc.com

(22)公司全称:奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115、1116、1307 室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:项晶晶
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn

(23)公司全称:浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址:浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号(锦昌大厦)1 幢 10 楼 1001 室
办公地址:杭州市拱墅区登云路 45 号(锦昌大厦)一楼金观诚财富
法定代表人:徐黎云
联系人:孙成岩
客服电话:400-068-0058
网址:www.jincheng-fund.com

(24)公司全称:上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址:上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
客服电话:4000-466-788
公司网址:www.66zichan.com

(25)公司全称:上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
办公地址:上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼
联系人:曹怡晨
客服电话:400-067-6266
网址:http://a.leadfund.com.cn/

(26)公司全称:上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人: 郭坚
联系人:何雪
客服电话:400-821-9031
公司网站:www.lufunds.com

(27)北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大厦 906 室
办公地址:北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 8 号楼新浪总部大厦
法定代表人:李昭琛
客服电话:010-62675369
网址: www.xincai.com

(28)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人:钱燕飞
联系人:王锋
客服电话:95177
公司网站:www.snjijin.com

3、基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。

(二)注册登记机构

名称:新华基金管理股份有限公司
住所:重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼第 19 层
办公地址:北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座
重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼第 19 层
法定代表人:陈重
电话:023-63711923
传真:023-63710297
联系人:陈献忱

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人:俞卫锋
电话:021—31358666
传真:021—31358600
联系人:安冬
经办律师:安冬、陆奇

(四)提供验资服务的会计师事务所

名称:瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层
办公地址: 北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层
法定代表人:杨剑涛
电话:010-88095588
传真:010—88091199
经办注册会计师:张伟、胡慰
联系人:胡慰

四 基金的名称

本基金名称:新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金。

五 基金的类型

基金类型:契约型开放式。

六 基金的投资目标

综合运用多种投资策略,在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,力争为投资人提供长期稳定的绝对回报。

七 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金及到期日在一年以内的政府债券,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0-95%,持有单只中小企业私募债券市值不超过基金资产净值的 10%,权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

八 基金的投资策略

投资策略的选择,本基金将兼顾下行风险控制和收益获取。在资产配置策略方面,主要采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在股票投资策略方面,把握趋势跟随及绝对收益两个核心,趋势跟随策略以期在某行业或个股出现趋势性机会时,积极跟随其市场表现;绝对收益策略以类套利策略为目标,以期获取稳定的绝对回报。在债券投资策略方面,本基金将综合运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略、中小企业私募债券投资策略及可转换债券投资策略,在获取稳定收益的同时,降低基金资产净值整体的波动性。

1、资产配置策略

本组合采用战略性资产配置与战术性资产配置相结合的策略,即在各类资产的投资比例范围内,持续评估各类资产的风险收益状况,并据此动态调整各类资产配置比例,以在控制基金资产净值下行风险的同时追求相对较高的收益。

基金管理人的宏观策略组及固定收益组采用定性和定量的研究方法对上述关键因素的运行状态、发展方向以及稳定程度进行深入分析和研究,并结合金融工程小组自行研发的量化趋势识别模型、量化风险度量模型以及第三方研究机构的研究成果定期或不定期向投资决策委员会和基金经理提交股票市场及债券市场趋势分析及风险评估报告。投资决策委员会在综合分析判断的基础上动态调整各类资产的配置比例范围,基金经理根据最新的市场运行情况以及对申购赎回情况的预期对大类资产在比例范围内进行适度微调。

2、股票投资策略

(1)趋势跟随策略

趋势跟随策略以期在某行业或个股出现趋势性机会时,积极跟随其市场表现。

行业配置策略主要基于对行业景气趋势的分析判断,依据不同行业景气趋势的周期长短采用核心—卫星配置策略。其中,核心资产重点配置于具有中长期景气上升趋势的行业,卫星资产则动态配置处于短期景气上升趋势之中的行业。

本基金通过对上市公司盈利增长趋势以及市场价格趋势两个维度的综合考量,将好公司与好股票有机结合,前瞻性地把握 A 股市场中存在的具有综合趋势机会的个股,进一步结合对上市公司品质的评价构建最终的投资组合。

(2)绝对收益策略

绝对收益策略以类套利策略为目标,以期获取稳定的绝对回报。

1)定向增发策略

本基金的定向增发策略将综合考虑标的股票所处行业发展状态、未来成长空间、募投项目情况以及折溢价率等因素,对定向增发股票进行合理配置。

① 行业发展状态

在行业的分析层面,本基金将重点关注定向增发标的股票所处行业的景气程度,估值水平以及未来成长性等因素。具体而言,本基金将通过综合的定性及定量分析,积极寻找预期进入景气上升期、行业估值水平较低且具备长期成长性的行业进行配置;对于目前正处于景气高点、行业估值水平偏高且长期缺乏成长性的行业本基金将适当回避。

② 标的股票未来成长空间

本基金将借鉴基金管理人独立开发并长期实践使用的成长股选股体系,并对定向增发标的股票未来 ROE(净资产收益率)以及 EPS(每股净收益)等指标进行重点分析和跟踪。一方面,行业研究员通过对标的股票(包含上市公司本身、上游供应商、下游客户以及竞争对手等)的实地调研,对公司的营运状况、竞争优势以及治理结构等情况进行定性的深入和全面的了解;另一方面,通过扎实的案头工作,定量评估各种公司数据并结合定性分析,对公司未来长期的成长空间做出判断。

③ 募投项目

本基金将重点考察募投项目的 ROE 是否高于公司整体 ROE 水平,项目产生效益的投资周期等因素。对于能够提升公司整体 ROE 并且投资周期短的项目,本基金将积极参与。

④ 折溢价率

本基金原则上将重点关注折价率较高的标的股票进行投资,但对于行业正处景气阶段、未来成长空间巨大以及募投项目的回报率可观的标的股票,在折价率可容忍的范围内适当参与。

2)事件驱动策略

本基金的事件驱动策略主要指通过分析影响上市公司股价波动的突发性事件,把握市场对上市公司的定价与实际价值之间的显著差异,对个股进行配置调整和优化,以获取事件发生前后价格与价值之间的回归收益。本基金的事件驱动策略将通过政策研判、公司调研、财报分析、数据收集、数据统计以及数据挖掘等一系列定性及定量的研究方法,对在合理持有期间内可获利的事件进行识别并积极参与。目前主要关注的事件包括资产重组、高管增持、股权激励以及高送转等,后期基金管理人将积极关注股票市场发展动态,以实证检验为根基,开发更适应市场环境的事件驱动模型及策略并加以应用。

① 资产重组

资产重组是指企业与企业外部的经济主体进行的,对企业资产、负债以及所有者权益等项目的分布状态进行重新组合、调整、配置的过程。资产重组往往会给企业带来资产结构和运营模式上的深远影响,进而带动资本市场对其进行价值重估。

② 高管增持

高管增持事件是指高管在二级市场的买入其公司股票的行为。从逻辑上分析,高管增持行为可以反映出管理层对于公司股价及公司未来发展状况的态度,大量的买入行为可能表示管理层认为目前公司价值被低估、价值提升空间较大,或者对于公司未来经营充满信心,认为公司未来的发展前景较好。

③ 股权激励

股权激励是一种通过经营者获得公司股权形式给予企业经营者一定的经济权利。股权激励的意图就是尽可能的同化股东和管理人的目标,驱使公司管理人员能够更多的关心股东的利益和企业的长期价值以使股东财富最大化。目前国内常用的股权激励方式有赋予公司的高级管理人员限制性股票、股票期权和股票增值权让管理人员也成为公司的股东或潜在的股东。从公司管理实践来看,股权激励对于改善公司治理结构,降低代理成本,提升管理效率,增强公司凝聚力和市场竞争力起到非常积极的作用。

④ 高送转

高送转行为本身对于上市公司而言只是财务报表上的调整,但高送转往往显示公司高速扩张的潜能,敢于不断的进行股本扩张,一般都有持续的业绩增长作后盾,说明企业对业绩持续增长抱有信心,不畏惧股本的增大;另一方面,送配后大幅除权使每股价格降低,股票的流动性也会有所增强,可以吸引更多的增量资金进入。

3)大宗交易策略

本基金的大宗交易策略是指通过大宗交易市场折价买入股票,较适当的时间内通过二级市场卖出,赚取大宗交易价格与二级市场价格之间的套利空间。在投资标的的选择方面,基金管理人一方面将重点关注标的股票在大宗交易市场的折价情况以保证获取足够的套利收益;另一方面将重点关注标的上市公司的未来成长性、市场估值水平以及二级市场成交活跃度等指标,以避免在合理的时间范围减持造成较高的冲击成本,降低获利空间。

3、债券投资策略

(1)久期策略

久期策略的目标是在预期利率上升时保全资本,预期利率下降时获得较高的资本利得。本基金将通过综合分析宏观经济指标(如国内生产总值、工业增加值、固定资产投资增速、价格指数、消费增长率、m1、m2、信贷增长、汇率、国外利率等)、宏观政策(如货币政策、财政政策、汇率政策等)以及市场指标(如新债券的发行利率与市场收益率的差异、中央银行的公开市场操作、回购利率等)预测利率的变动方向、范围和幅度。

具体而言,当预期利率上升,本基金将缩短债券组合的平均久期,在规避市场风险的同时,获取再投资收益。当预期利率下降,本基金将增加债券组合的平均久期,获取因利率下降所带来的资本利的收益。

(2)收益率曲线策略

本基金在短期、中期、长期品种的配置上主要采用收益率曲线策略。

债券收益率曲线形状在受到央行货币政策、公开市场操作、经济增长率、通货膨胀率、货币供应量和市场预期等多种因素的影响下,可能发生平行移动、非平行移动(平坦化、陡峭化、扭曲)等变动。收益曲线策略就是通过对市场收益率曲线的非平行变动预期,追求获得因收益曲线变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。

本基金将用情景分析的手段比较不同的收益曲线投资策略,即子弹策略(构成组合的证券期限集中于收益率曲线上某一点)、梯形策略(构成组合内每种期限的证券数量基本相当)和哑铃策略(构成组合中的证券的期限集中到两个极端期限),采取当时市场状况下相应的最优投资策略,确定债券资产中短期、中期、长期品种的配置比例。

(3)信用策略

本基金主要投资信用债券,主要包括:金融债券(不含政策性金融债)、企业债券、公司债券、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、中期票据、资产支持证券等除国债和中央银行票据之外的、非国家信用的固定收益类债券。因此,信用策略是本基金固定收益类资产投资策略的重要组成部分。

本基金的信用策略主要包含信用利差曲线配置、个券精选策略、信用调整策略以及信用风险控制等方面。

1)信用利差曲线策略

信用债收益率是在基准收益率基础上加上反映信用风险的信用利差,因此信用债利差曲线能够直接影响相应债券品种的信用利差收益率。总体而言,本基金将重点关注信用利差趋向缩小的类属品种及个券。在信用利差曲线的分析上,本基金将重点关注如下因素:

① 经济周期:经济周期的变化对信用利差曲线的变化影响很大,在经济上行阶段,企业盈利状况持续向好,经营现金流改善,则信用利差可能收窄,而当经济步入下行阶段时,企业的盈利状况减弱,信用利差可能会随之扩大。

② 国家政策也会对信用利差造成很大的影响,例如政策放宽企业发行信用债的审核条件,则将扩大发行主体的规模,进而扩大市场的供给,信用利差有可能扩大。

③ 行业景气度的好转往往会推动行业内发债企业的经营状况改善,盈利能力增强,从而可能使得信用利差相应收窄,而行业景气度的下行可能会使得信用利差相应扩大。

④ 债券市场供求、信用债券市场结构和信用债券品种的流动性等因素的变化趋势也会在较大程度上影响信用利差曲线的走势,比如,信用债发行利率提高,相对于贷款的成本优势减弱,则信用债券的发行可能会减少,这会影响到信用债市场的供求关系,进而对信用利差曲线的变化趋势产生影响。

2)个券精选策略

本基金将借助本基金管理人内部的行业及公司研究员的专业研究能力,并综合参考外部权威、专业研究机构的研究成果,对发债主体进行深入的基本面分析,并结合债券的发行条款(包含期限、票息率、赎回特点、增信方式、提前偿还和赎回等条款),以确定信用债券的实际信用风险状况及其信用利差水平,挖掘并投资于信用风险相对较低、信用利差相对较高的优质品种。具体的分析内容及指标包括但不限于国民经济运行的周期阶段、债券发行人所处行业发展前景、发行人业务发展状况、企业市场地位、财务状况(包含盈利能力、偿债能力、现金流获取能力、运营能力等)、管理水平及其债务水平等。

3)信用调整策略

除受宏观经济和行业周期影响外,信用债券本身素质的变化是影响个券信用变化的重要因素,包括公司治理结构、股东背景、管理水平、经营状况、财务状况、融资能力等经营管理和偿债能力指标。本基金将通过信用债跟踪评级制度,在个券本身素质发生变化后进行严谨评价,以判断个券未来信用发生变化的方向,从而发掘价值低估债券或规避信用风险。

4)信用风险控制:

本基金将从如下方面进行信用风险控制:

① 根据国家有权机构批准或认可的信用评级机构的信用评级,依靠基金管理人内部信用分析团队,同时整合基金管理人外部有效资源,深入分析挖掘发债主体的经营状况、现金流、发展趋势等情况

② 严格遵守信用类债券的备选库制度,根据不同的信用风险等级,按照不同的投资管理流程和权限管理制度,对入库债券进行定期信用跟踪分析。

③ 采取分散化投资策略和集中度限制,严格控制组合整体的违约风险水平。

4、中小企业私募债券选择策略

本基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,只选择并投资债券剩余期限与保本周期剩余期限相匹配的个券,并且制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

本基金主要通过定量与定性相结合的研究及分析方法进行中小企业私募债券的选择和投资。定性分析重点关注所发行债券的具体条款以及发行主体情况。

(1)定量分析

定量分析方面,本基金重点关注债券发行人的财务状况,包括发行主体的偿债能力、盈利能力、现金流获取能力以及发行主体的长期资本结构等。具体关注指标如下:

① 偿债能力:重点关注流动比率、速动比率、利息保障倍数以及现金利息保障倍数等指标;

② 盈利能力:重点关注 ROE、ROA、毛利率以及净利率等指标;

③ 现金流获取能力:重点关注销售现金比率、资产现金回收率等指标;

④ 资本结构:重点关注资产负债率指标。

(2)定性分析

定性分析重点关注所发行债券的具体条款以及发行主体情况。主要包括债券发行的基本条款(包括私募债券名称、本期发行总额、期限、票面金额、发行价格或利率确定方式、还本付息的期限和方式等)、募集资金用途、转让范围及约束条件、偿债保障机制、股息分配政策、担保增信情况、发行主体历史发行债券及评级情况以及发行主体主营业务发展前景等方面。

5、收益率曲线骑乘策略

债券收益的来源主要由两大部分组成,第一部分是息票收入,第二部分是资本利得收入。在息票收入固定的情况下,通过主动式债券投资的管理,尽可能多的获取资本利得收入是提高本基金收益的重要手段。而资本利得收入主要是通过债券收益率下降取得的,基于此,本基金提出了骑乘策略。

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券的收益率的下滑,进而获得资本利得收益。

骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度,若收益率曲线较为陡峭,则随着债券剩余期限的缩短,债券的收益率水平将会有较大下滑,进而获得较高的资本利得。

6、杠杆放大策略

当债券市场出现上升行情时,由于现券收益率较高,市场资金成本较低时,本基金可以不断利用正回购的方式进行滚动操作,放大资金规模、获得超额收益。当债券市场出现下降行情时,由于现券收益率低,市场资金成本高时,本基金可以通过买断式逆回购,在降低债券仓位的同时获取超额收益。

7、可转换债券投资策略

(1)投资策略

基于基金管理人可转换债券价值评估体系,综合定性与定量分析指标确定可转换债券的投资价值,从中精选具备良好发展潜力或正股具备较高上涨预期且市场价格处于合理水平的可转换债券进行投资。

定性方面,重点分析可转换债券对应正股所处行业、成长性、估值情况等基本面指标;定量方面,重点分析平价溢价率、底价溢价率、Delta 系数、转债条款等指标。

(2)转股策略

根据市场情况的变化灵活确定转股策略,以有效保障或提高基金利益。

转股期内,如果存在明显市场套利机会,即本基金所持有的可转换债券的实际转股价格明显低于对应正股的市场价格,将通过转股方式实现获利。

如果可转换债券在变现过程中可能出现较大的变现损失,将通过转股方式保障基金资产的流动性。

如果可转换债券对应正股价格上涨且满足赎回触发条件,将通过转股方式保障已有收益。

8、资产支持证券的投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等。可以从信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素等五个方面进行考虑。其中信用因素是目前最重要的因素,本基金运用 CreditMetrics 模型——信用矩阵来估计信用利差。该模型的方法是估计一定期限内,债券及其它信用类产品构成的组合价值变化的远期分布。这种估计是通过建立信用评级转移矩阵来实现的。其中先对单个资产的信用风险进行分析,然后通过考虑资产之间的相关性和风险头寸,把模型推广到多个债券或贷款的组合。

九 基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为:年化收益率 10%

本基金为混合型基金,力争在本基金的投资运作期间为投资者提供稳定的绝对回报,因此,以年化收益率 10%作为本基金业绩比较基准,能够较好反应本基金的产品特性及风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时,本基金管理人可以在与基金托管人协商一致的情况下,履行相关程序,并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

十一 基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——平安银行股份有限公司根据本基金合同规定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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 9 月 30 日。

(一)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	123,454,329.48	47.22
	其中:股票	123,454,329.48	47.22
2	固定收益投资	751,836.38	0.29
	其中:债券	751,836.38	0.29
	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	136,581,514.46	52.24
7	其他各项资产	654,641.01	0.25
8	合计	261,442,321.33	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

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	–	–
C	制造业	99,258,784.88	39.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,455.24	0.03
E	建筑业	219,121.41	0.09
F	批发和零售业	3,603,987.87	1.42
G	交通运输、仓储和邮政业	3,744,661.59	1.48
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,875,172.36	1.53
J	金融业	1,978,897.40	0.78
K	房地产业	4,844,954.40	1.91
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	1,514,256.50	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	2,454,725.00	0.97
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	393,312.83	0.16
S	综合	1,498,000.00	0.59
	合计	123,454,329.48	48.76

(三)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	000100	TCL 集团	2,500,000	8,550,000.00	3.38
2	300123	太阳鸟	380,416	5,736,673.28	2.27
3	002317	众生药业	350,000	4,609,500.00	1.82
4	601689	拓普集团	150,995	4,245,979.40	1.68
5	300200	高盟新材	250,000	4,037,500.00	1.59
6	002536	西泵股份	250,400	3,600,752.00	1.42
7	600103	青山纸业	500,000	3,545,000.00	1.40
8	000797	中国武夷	200,680	3,527,954.40	1.39
9	600689	上海三毛	180,000	3,312,000.00	1.31
10	600861	北京城乡	207,714	3,180,101.34	1.26

(四)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	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	751,836.38	0.30
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	751,836.38	0.30

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	128011	汽模转债	5,408	751,836.38	0.30

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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资产支持证券。

(七)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。

(八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本报告期末未持有权证。

(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

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。

(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本基金投资国债期货的投资政策

本报告期末本基金无国债期货投资。

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。

3、本基金投资国债期货的投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

(十一)投资组合报告附注

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。

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。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	624,418.47
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	23,812.54
5	应收申购款	6,410.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	654,641.01

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	128011	汽模转债	751,836.38	0.30

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	300123	太阳鸟	5,736,673.28	2.27	重大事项停牌
2	000100	TCL 集团	8,550,000.00	3.38	重大事项停牌

6、其他需说明的重要事项

由于四舍五入的原因,分项和与合计之间可能存在尾差。

十二 基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下:

(一)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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2014.4.16-2014.12.31	-2.70%	0.74%	7.12%	0.00%	4.42%	0.74%
2015.1.01-2015.12.31	86.13%	2.13%	10.00%	0.00%	76.13%	2.13%
2016.1.01-2016.6.30	-10.16%	1.48%	4.99%	0.00%	-15.15%	1.48%
过去 3 个月(2016.7.01-2016.9.30)	2.52%	0.49%	2.52%	0.00%	0.00%	0.49%
自基金成立至今(2014.4.16-2016.9.30)	65.22%	1.65%	24.63%	0.00%	40.59%	1.65%

(二)自基金合同生效以来基金累计份额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

新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金
份额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 4 月 16 日至 2016 年 9 月 30 日)

注:报告期内本基金的各项比例符合基金合同的有关约定。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。 投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

十三 基金的费用概览

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times1.5\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times0.25\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、销售服务费的计提比例和计提方法

在通常情况下,基金的销售服务费按基金资产净值的 0.5%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times0.5\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日基金资产净值

销售服务费自基金管理人公告的正式收取日起,每日计提,按月支付。

基金管理人依据基金合同及届时有效的有关法律法规收取基金销售服务费或酌情降低基金销售服务费的,无须召开基金份额持有人大会,但应最迟于调整日 2 日前在中国证监会指定媒介公告。

上述“(一)基金费用的种类中第 3-8 项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售方法》、《信息披露办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金管理人于 2016 年 5 月 30 日刊登的本基金招募说明书(《新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新》)进行了更新,主要更新的内容如下:

1. 在“重要提示”中,明确了更新的招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2. 在“三、基金管理人”中,更新了主要人员情况。
3. 在“四、基金托管人”中,更新了基金托管人的相关信息。
4. 在“五、相关服务机构”中,更新了其他销售机构的信息。
5. 在“九、基金的投资”中,更新了本基金投资组合报告的内容,数据截至时间为 2016 年 9 月 30 日。
6. 更新了“十、基金的业绩”的数据。
7. 在“二十二、其他应披露事项”中,披露了自 2016 年 4 月 17 日至 2016 年 10 月 16 日期间本基金的公告信息:

1)本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。
2)2016 年 4 月 21 日新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告
3)2016 年 4 月 25 日新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告
4)2016 年 4 月 29 日新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销系统招商银行网银支付费率优惠的公告
5)2016 年 5 月 5 日新华基金管理股份有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告
6)2016 年 5 月 30 新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要及全文
7)2016 年 6 月 6 日新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿为销售机构并参加费率优惠活动的公告
8)2016 年 6 月 13 日新华基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告
9)2016 年 6 月 13 日新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通定投业务并参加费率优惠活动的公告
10)2016 年 7 月 1 日新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2016 年半年度最后一个交易日资产净值揭示公告
11)2016 年 7 月 2 日新华基金管理股份有限公司关于旗下基金通过上海浦东发展银行股份有限公司申购基金费率优惠的公告
12)2016 年 7 月 19 日新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告
13)2016 年 7 月 27 日新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告
14)2016 年 8 月 24 日新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告
15)2016 年 9 月 5 日新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加苏宁基金销售公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告
16)2016 年 9 月 21 日新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构并开通基金定投、转换业务以及参加费率优惠活动的公告

新华基金管理股份有限公司
2016 年 11 月 29 日

新华基金管理股份有限公司
关于旗下部分基金增加汇付金融为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告

公告送出日期:2016 年 11 月 29 日

一、增加销售机构

根据新华基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”)与上海汇付金融服务有限公司(以下简称“汇付金融”)签署的销售协议,该机构将自 2016 年 12 月 1 日起销售本公司旗下的部分基金。

适用基金如下:

基金名称	基金代码
新华策略精选股票型证券投资基金	001040
新华优选分红混合型证券投资基金	519087
新华优选成长混合型证券投资基金	519089
新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金	519091
新华钻石品质企业混合型证券投资基金	519093
新华行业周期轮换混合型证券投资基金	519095
新华中小市值优选混合型证券投资基金	519097
新华灵活主题混合型证券投资基金	519099
新华优选消费混合型证券投资基金	519150
新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金	A 类:519156;C 类:519157
新华趋势领航混合型证券投资基金	519158
新华鑫安保本一号混合型证券投资基金	519167
新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金	001294
新华鑫回报混合型证券投资基金	001682
新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金	000584
新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金	519165
新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金	001004
新华纯债添利债券型发起式证券投资基金	A 类:519152;C 类:519153
新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金	A 类:519160;C 类:519161
新华信用增益债券型证券投资基金	A 类:519162;C 类:519163
新华惠鑫分级债券型证券投资基金	A 类:164303
新华增盈回报债券型证券投资基金	000973
新华壹诺宝货币市场基金	A 类:000434;B 类:003267
新华活期添利货币市场基金	A 类:000903;B 类:003264
新华中证环保产业指数分级证券投资基金	164304
新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金	001681
新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金	002272
新华信用增强债券型证券投资基金	A 类:002421;C 类:002422
新华丰盈回报债券型证券投资基金	002866
新华双利债券型证券投资基金	A 类:002765;C 类:002766
新华恒稳添利债券型证券投资基金	002867
新华丰利债券型证券投资基金	A 类:003221;C 类:003222
新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金	A 类:002083;C 类:002084
新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金	002715
新华鑫锐混合型证券投资基金	001622

从 2016 年 12 月 1 日起,投资者可通过汇付金融办理上述基金的申购(包括定期定额)、赎回等业务,具体业务规则请参考汇付金融网站的相关规定。

二、参加申购费率优惠活动

自 2016 年 12 月 1 日起,投资者通过汇付金融申购(包括定期定额)本公司旗下基金可享受申购(包括定期定额)费率优惠,申购(包括定期定额)费率不设折扣限制,具体折扣费率以汇付金融网站公示为准,敬请投资者留意汇付金融的相关公告。优惠前申购(包括定期定额)费率为固定费用的,则按原费率执行,不再享有费率折扣。原费率指各基金法律文件中规定的标准费率。

费率优惠活动期间,业务办理的具体程序以汇付金融的相关规定为准。优惠活动的具体规定如有变化,敬请投资者留意汇付金融网站的相关公告。

三、其他需要提示的事项

1、本优惠活动仅适用于本公司产品在汇付金融处于正常申购期的基金产品的前端收费模式的申购手续费,不包括基金赎回等其他业务的手续费。

2、投资者在汇付金融办理本公司旗下基金的申购(包括定期定额)、赎回等业务,具体办理规则请遵循汇付金融的相关业务规定。

3、上述申购费率优惠活动的解释权归汇付金融所有。

4、上述申购费率优惠活动的结束日期以汇付金融公告为准。

5、投资者欲了解上述基金产品的详细情况,请仔细阅读刊登于本公司网站(www.ncfund.com.cn)的基金《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,以及相关业务公告。

6、投资者可以通过以下途径咨询有关事宜

(1)上海汇付金融服务有限公司
客服电话:400-820-2819
网址:fund.bundtrade.com

(2)新华基金管理股份有限公司
客服电话:400-819-8866
网址:www.ncfund.com.cn

四、风险提示

本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。本公司充分重视投资者教育工作,以保障投资者利益为己任,特此提醒广大投资者正确认识投资基金所存在的风险,慎重考虑、谨慎决策,做理性的基金投资者,享受长期投资理财的快乐!

特此公告。

新华基金管理股份有限公司
2016 年 11 月 29 日

新华基金管理股份有限公司
关于旗下基金参加钱景财富开展的基金申(认)购费率优惠活动的公告

公告送出日期:2016 年 11 月 29 日

为答谢广大客户长期以来给予的信任与支持,经与北京钱景财富投资管理有限公司(以下简称“钱景财富”)协商一致,新华基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”)决定旗下基金参加钱景财富开展的基金的申(认)购费率优惠活动。现将具体费率优惠情况公告如下:

一、费率优惠

1、费率优惠内容

自2016年12月1日起,投资者通过钱景财富申(认)购本公司旗下基金,申(认)购费率不设折扣限制,具体折扣费率以钱景财富网站公示为准。基金原费率请详见基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

费率优惠期限内,如本公司新增通过钱景财富代销的基金产品,则自该基金产品开放申(认)购当日起,将同时开通该基金上述费率优惠。

2、费率优惠期限

费率优惠期限以钱景财富官方网站所示公告为准。

二、重要提示

1、本费率优惠仅适用于本公司产品在钱景财富处于正常申购期的基金产品的前端收费模式的申购手续费(含定期定额投资业务产生的申购手续费)及处于基金募集期的基金认购费。

2、本费率优惠仅适用于本公司产品在钱景财富申(认)购业务的手续费,不包括基金赎回、转换业务等其他业务的手续费。

3、费率优惠解释权归本公司所有,有关费率优惠的具体规定如有变化,敬请投资者留意钱景财富的有关规定。

4、费率优惠期间,业务办理的流程以钱景财富的规定为准。投资者欲了解基金产品的详细情况,请仔细阅读基金的基金合同、招募说明书(更新)等法律文件。

三、投资者可通过以下途径了解或咨询相关情况

机构名称	网址	客服热线
北京钱景财富投资管理有限公司	www.niuji.net	400-893-6885
新华基金管理股份有限公司	www.ncfund.com.cn	400-819-8866

四、风险提示

本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书。

特此公告。

新华基金管理股份有限公司
2016年11月29日