

# 新沃通盈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：新沃基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年四月二十二日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，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	新沃通盈灵活配置混合
交易代码	002564
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日
报告期末基金份额总额	1,973,754.82 份
投资目标	本基金以风险管理为前提，通过把握中国稳增长与促转型的发展现状，灵活运用多种投资策略，挖掘各大类资产配置机会，力求高于业绩比较基准的长期资产增值。
投资策略	本基金在深度把握中国经济发展与转型的基础上，通过自上而下的宏观-中观-微观的资产配置策略，以及自下而上的精选行业、个股的基本面分析策略，再通过定性分析和定量分析相结合的选股方法，辅以多种事件驱动、量化研究等工具策略，在风险管理的前提下因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产长期增值。
业绩比较基准	65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	新沃基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

### § 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	235,973.15
2. 本期利润	235,973.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0204
4. 期末基金资产净值	2,108,333.65
5. 期末基金份额净值	1.068

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

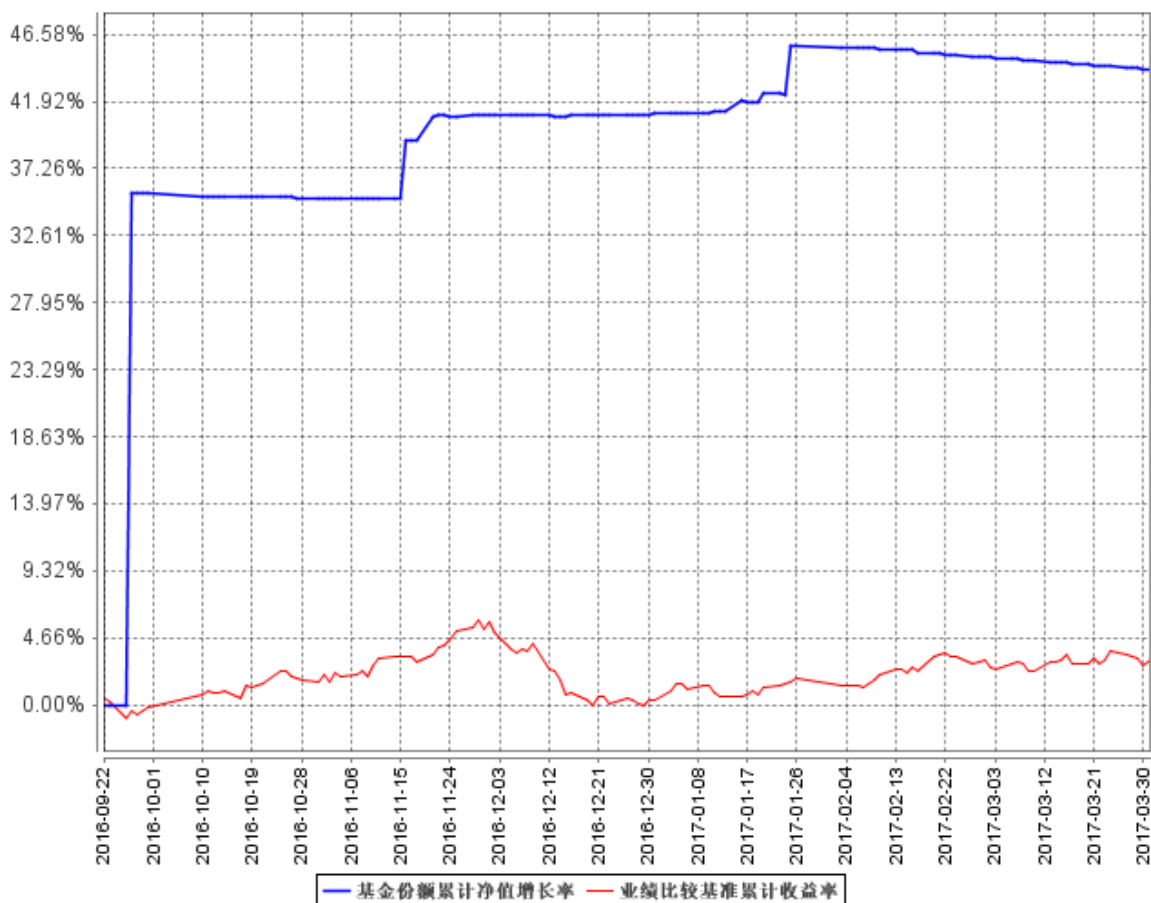
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	2.10%	0.32%	2.74%	0.34%	-0.64%	-0.02%

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2016 年 9 月 22 日生效，基金合同生效起至本报告期末未满一年。

2、本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的投资组合比例符合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		
邵将	本基金的基金经理、投资总监	2016 年 9 月 22 日	-	4 年	物理学硕士，中国籍。2012 年 6 月至 2016 年 6 月任职于天弘基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员，兼任制造行业组组长

					长。2016 年 7 月加入新沃基金管理有限公司。
--	--	--	--	--	---------------------------

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年底各类行业数据显示经济周期见底并开始回升，这种周期性回升在 2016 年三季度见顶，并高位震荡持续到 2017 年一季度。2017 年一季度 PPI 见顶，通胀温和可控，中游周期行业设备更换周期叠加补库周期令其盈利持续性修复，但在经济周期复苏以及金融去杠杆的环境下，流动性易紧难松，这将压制市场估值体系的提升。鉴于此本产品在市场成交量有效放大前，采取较为谨慎的策略，放弃对热点的追逐，在明确的趋势性机会出现前，控制风险和仓位。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金基金份额净值收益率为 2.10%，同期业绩基准收益率 2.74%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未有连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况出现；本基金资产净值于 2017 年 1 月 11 日至 2017 年 3 月 31 日期间已连续 53 个工作日低于 5000 万元。本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,088,587.14	96.26
8	其他资产	81,107.96	3.74
9	合计	2,169,695.10	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有投资股票。

### 5.3 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。

### 5.4 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资产支持证券。

### 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.9 投资组合报告附注

**5.9.1 报告期内，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体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。**

**5.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。**

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	462.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	80,645.71
8	其他	-
9	合计	81,107.96

### 5.9.4 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。

### 5.9.5 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情况。

### 5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	49,088,164.47
报告期期间基金总申购份额	2,233,647.00
减：报告期期间基金总赎回份额	49,348,056.65
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,973,754.82

## § 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	1,878,908.13
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,878,908.13
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	95.19

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2017年1月24日	1,878,908.13	2,000,000.00	0.80%
合计			1,878,908.13	2,000,000.00	

## § 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	2017/1/1-2017/1/25	40,679,733.73	0.00	40,679,733.73	0.00	0.00
	2	2017/1/25-2017/3/31	0.00	1,878,908.13	0.00	1,878,908.13	95.19
产品特有风险							
<p>本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。公司对该基金拥有完全自主投资决策权。报告期末本基金以现金为主，单一投资者赎回本基金基本不会给本基金带来显著的流动性风险，但因基金单位净值最末位小数致四舍五入的原因，单一投资者赎回本基金可能给存续投资者带来一定程度的净值损失。</p>							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“新沃通盈”或“本基金”）基金份额



持有人大会于 2017 年 1 月 23 日以通讯方式在北京召开，会议审议并通过了《关于调整新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金管理费率及托管费率并修改基金合同的议案》（以下简称“议案”）。根据议案，经与基金托管人协商一致，基金管理人已将本基金的管理费率修改为 0.60%，托管费率修改为 0.15%。基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告及相关备查文件已报中国证监会备案，修订和更新后的文件于 2017 年 1 月 23 日生效。

2、当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 9.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

新沃基金管理有限公司

2017 年 4 月 22 日