华安新利灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2019-04-20

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标、基金净值表现
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 审计报告
§7 投资组合报告
§8 基金份额持有人户数及持有人结构情况
§9 开放式基金持有人大会决议
§10 影响投资者决策的其他重要信息
§11 备查文件目录

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根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，保证复核内容的真实性、准确性和完整性。

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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期内2019年1月1日至3月31日。

§2 基金简介

基金基本情况

项目	内容
基金名称	华安新利灵活配置混合型证券投资基金
交易代码	003003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006-12-08
报告期末基金份额总额	296,106,101.14份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过灵活配置股票投资与固定收益类资产，在长期稳定获取较高收益的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。在长期内跑赢一定比例的业绩比较基准。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将根据宏观经济环境、证券市场估值水平、利率水平、市场流动性等因素的变化，灵活调整股票、债券等大类资产的配置比例。 2、股票投资策略 本基金将根据宏观经济、证券市场估值水平、市场流动性等因素的变化，灵活调整股票投资比例。在股票投资方面，主要采用自下而上的方法，根据上市公司的盈利能力、成长性、估值水平等因素，从市场上的广阔空间中，选择具有较强盈利能力、成长性和较低估值水平的上市公司作为本基金的股票投资对象。 3、本基金债券投资策略 本基金将根据宏观经济、证券市场估值水平、利率水平、市场流动性等因素的变化，灵活调整债券投资比例。在债券投资方面，主要采用久期管理、收益率曲线管理、信用分析、骑乘策略、息差策略、可转债投资、资产支持证券投资等多种策略，通过合理的管理组合，以期在控制风险的前提下，获取较高的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。基于证券投资基金中的不同风险特征，本基金将风险分散于股票投资和债券投资两大类资产，以期在控制风险的前提下，获取较高的收益。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属两类基金的基金简称	华安新利灵活A	华安新利灵活C
下属两类基金的交易代码	003003	003004
报告期末下属两类基金的份额总额	200,404,361.78份	295,822.36份

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-01-01）-2019-03-31	截至报告期末（2019-03-31）
本期已实现盈益	-4,554,416.98	-2,276.40
本期利润	-10,727,302.42	-5,410.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0240	-0.0032
期末基金资产净值	221,207,402.32	197,460.72
期末基金份额净值	1.1035	1.1018

注：1、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：回购式基金交易、申购式基金赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现盈益指本基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除费用后的余额。本期利润为本期已实现盈益加上本期公允价值变动损益。

基金净值表现

本期利润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
2019-1-1-2019-3-31	-4.99 %	0.28 %	-15.09 %	0.24 %	10.10 %	0.04 %

本基金累计净值收益率与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
2019-1-1-2019-3-31	-4.90 %	0.28 %	-15.09 %	0.24 %	10.19 %	0.04 %

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

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

§3 管理人报告

管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同的规定，在基金运作中，勤勉尽责地为基金持有人谋取利益。严格控制投资风险，力争在长期稳定获取较高收益的基础上，实现基金资产的长期稳健增值。不存在违法违规或未履行义务的情况发生。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

报告期内，公平交易制度执行情况：

公平交易制度的执行情况：

1、公平交易制度的执行情况

公平交易制度的执行情况：

报告期内，公平交易制度的执行情况：