

新华精选低波动股票型证券投资基金
(原新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型)

2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 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：二〇一八年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2018年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金第三个保本周期于2018年1月26日到期，在第三个保本周期到期操作期间截止日的次日，即2018年2月3日起原新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。原新华鑫安保本一号混合型证券投资基金报告期自2018年1月1日至2018年2月2日止，新华精选低波动股票型证券投资基金报告期自2018年2月3日至2018年6月30日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.1 基金净值表现	7
3.3 其他指标	错误!未定义书签。
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
报表附注	19
7 投资组合报告	61
7.1 期末基金资产组合情况	61
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	62
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	63
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
7.6 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.....	65
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	66
7.8 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贵金属投资明细.....	66
7.9 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.....	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注	67

8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	72
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	错误!未定义书签。
9 开放式基金份额变动	72
10 重大事件揭示	73
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	74
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8 其他重大事件.....	78
11 影响投资者决策的其他重要信息	80
12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录.....	81
12.2 存放地点.....	82
12.3 查阅方式.....	82

2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 新华精选低波动股票型证券投资基金

基金名称	新华精选低波动股票型证券投资基金
基金简称	新华精选低波动股票
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	2018年2月3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
报告期末基金份额总额	474,538,910.99份

2.1.2 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

基金名称	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	585,855,385.12份

2.2 基金产品说明

2.2.1 新华精选低波动股票型证券投资基金

投资目标	在具有低波动率特质的股票组合中，精选价值低估且质地优良的上市公司进行重点投资，力求在有效控制风险的前提下，实现基金净值增长率持续稳定的超越业绩比较基准。
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略及其他投资策略。
业绩比较基准	80%×沪深 300 波动率加权指数收益率+20%×上证国债指数收益率

风险收益特征	本基金是股票型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
--------	--

2.2.2 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩
	联系电话	010-68779688
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn
客户服务电话	4008198866	95599
传真	010-68779528	010-68121816
注册地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	400010	100031
法定代表人	陈重	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn

基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地
-------------	-----------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 新华精选低波动股票型证券投资基金

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 2 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-60,919,668.73
本期利润	-72,576,056.24
加权平均基金份额本期利润	-0.1518
本期加权平均净值利润率	-15.49%
本期基金份额净值增长率	-14.33%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	52,278,124.75
期末可供分配基金份额利润	0.1102
期末基金资产净值	432,171,837.24
期末基金份额净值	0.9107
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.33%

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 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
过去一个月	-5.28%	0.63%	-7.45%	0.84%	2.17%	-0.21%
过去三个月	-7.01%	0.46%	-7.57%	0.75%	0.56%	-0.29%
自基金合同生效起至今	-14.33%	0.55%	-11.87%	0.82%	-2.46%	-0.27%

注：1、本基金业绩比较基准为 80%×沪深 300 波动率加权指数收益率+20%×上证国债指数收益率

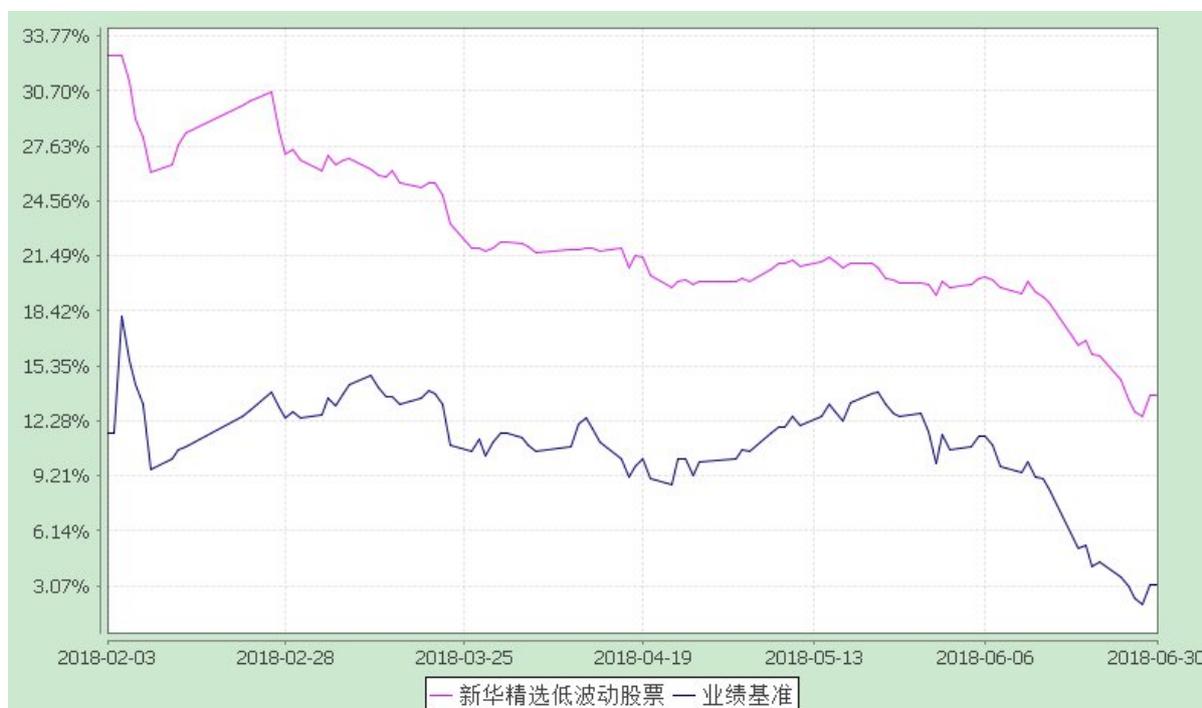
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.1.2.2 自基金转型以来基金份额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

新华精选低波动股票型证券投资基金

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

(2018 年 2 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：1、本基金转型日为 2018 年 2 月 3 日，本基金基金名称变更为新华精选低波动股票型证券投资基金。

2、本基金建仓期为 6 个月，截至报告期末本基金处于建仓期。

3、本报告期末本基金各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 2 日)
本期已实现收益	13,849,862.88
本期利润	6,178,542.88
加权平均基金份额本期利润	0.0045
本期加权平均净值利润率	0.42%
本期基金份额净值增长率	0.38%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 2 月 2 日)
期末可供分配利润	153,682,493.26
期末可供分配基金份额利润	0.2729

期末基金资产净值	622,701,557.07
期末基金份额净值	1.0630
3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 2 月 2 日)
基金份额累计净值增长率	32.69%

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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
过去一个月	0.38%	0.35%	0.32%	0.01%	0.06%	0.34%
过去三个月	0.57%	0.27%	0.95%	0.01%	-0.38%	0.26%
过去六个月	1.63%	0.21%	1.91%	0.01%	-0.28%	0.20%
过去一年	4.83%	0.17%	3.90%	0.01%	0.93%	0.16%
过去三年	15.27%	0.31%	12.77%	0.01%	2.50%	0.30%
自基金合同生效起 2018 年 2 月 2 日	32.69%	0.31%	17.06%	0.01%	15.63%	0.30%

注：1、本基金业绩比较基准为(一年期银行定期存款税后收益率+1%)×1.5

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

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 06 月 18 日至 2018 年 2 月 2 日)



注：本报告期末本基金各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于2004年12月9日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至2018年6月30日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华精选低波动股票型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合

型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫锐混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金、新华华丰灵活配置混合型证券投资基金和新华安享惠钰定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 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，新华丰利债券型证券投资基金基金经理、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理。	2016-05-25	-	6	经济学博士，历任新华基金管理股份有限公司宏观研究、策略研究、信用评级、基金经理助理
王滨	本基金基金经理，固定收益与平衡投资部副总监、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理。	2017-07-13	-	11	管理学硕士，历任中国工商银行总行固定收益投资经理、中国民生银行投资经理、民生加银基金管理有限公司基金经理、新华基金管理股份有限公司投资经理。

	经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。				
--	-------------------------	--	--	--	--

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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，新华基金管理股份有限公司作为新华精选低波动股票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》、《新华精选低波动股票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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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

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

2018 年上半年地产投资保持高位、制造业投资回暖、消费平稳支撑短期经济平稳运行，同时通胀水平维持稳定低位。在贸易战持续升温、经济预期转向悲观及信用违约风险频发的情况下，货币政策较前期显著转松。债券市场收益率出现全面下行，但信用风险出现放大趋势。股票市场在去杠杆深化、贸易摩擦升级、信用风险加剧等多重因素作用下悲观情绪继续放大，整体市场走势较为极端，其中食品饮料及医药等防御板块表现相对好于其他板块。

本基金在基金转型后以配置经营稳健的低估值低波动率蓝筹为主，但鉴于蓝筹波动率显著放大且风格因素较为极端，导致本应相对稳定的蓝筹跌幅较深，净值出现了较大回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额净值为 0.9107 元，自本基金第三个保本期到期操作期间截止日的次日（2018 年 2 月 3 日）起至本报告期期末，本基金份额净值增长率为-14.33%，同期业绩比较基准收益率为-11.87%。

截止本基金第三个保本期到期操作期间截止日（2018 年 2 月 2 日），原新华鑫安保本一号混合型证券投资基金份额净值为 1.0630 元。本报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 2 日），原新华鑫安保本一号混合型证券投资基金份额净值增长率为 0.38%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，房地产及地产产业链下行压力加大，外部环境不确定性仍然较高，对经济平稳增长构成一定压力，PPI、CPI 价格增速预计温和适中，去杠杆政策节奏预计适度放缓。在此背景下，宽货币的基调不会改变，政策将更多关注宽信用稳经济的效果。目前股票市场在多重负面因素压制下持续调整，市场悲观预期持续发酵，但整体估值已经趋于低估，部分板块更是创下历史新低。长期来看市场机会显著大于风险，但短期内市场在内外负面因素的影响下仍需要谨慎应对。

未来具体投资方向将调整仓位逐步加仓配置行业发展空间大、国家鼓励支持的新经济行业，同时配置部分股价调整幅度和时间充分，基本面出现一定底部改善的行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部门、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

二、基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部门相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部门的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；

- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

四、交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

五、监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资管理部门问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金从2018年5月14日到2018年6月29日连续34个工作日基金持有人数低于200户。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 新华精选低波动股票型证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体：新华精选低波动股票型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	16,086,923.36
结算备付金		1,763,221.09
存出保证金		727,874.53
交易性金融资产	6.4.7.2	272,743,702.30
其中：股票投资		212,619,702.30
基金投资		-
债券投资		60,124,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	153,440,415.13
应收证券清算款		5,540,937.53

应收利息	6.4.7.5	1,115,973.11
应收股利		-
应收申购款		998.50
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		451,420,045.55
负债和所有者权益		本期末 2018年6月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		16,472,123.92
应付赎回款		-
应付管理人报酬		553,093.39
应付托管费		73,745.76
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.6	1,917,061.03
应交税费		4,075.34
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	228,108.87
负债合计		19,248,208.31
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.8	379,893,712.49
未分配利润	6.4.7.9	52,278,124.75
所有者权益合计		432,171,837.24
负债和所有者权益总计		451,420,045.55

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9107 元，基金份额 474,538,910.99 份。

6.1.2 利润表

会计主体：新华精选低波动股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年2月3日至 2018年6月30日
一、收入		-66,049,429.77
1.利息收入		3,530,855.56
其中：存款利息收入	6.4.7.10	214,741.25
债券利息收入		1,258,887.49
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,057,226.82
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-57,924,059.36
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-60,334,823.24
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	223,026.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	2,187,737.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-11,656,387.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	161.54
减：二、费用		6,526,626.47
1. 管理人报酬		2,865,077.06
2. 托管费		382,010.27
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	3,047,642.73
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3,522.29
7. 其他费用	6.4.7.21	228,374.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-72,576,056.24
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-72,576,056.24

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华精选低波动股票型证券投资基金

本报告期：2018年2月3日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	469,019,063.81	153,682,493.26	622,701,557.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-72,576,056.24	-72,576,056.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-89,125,351.32	-28,828,312.27	-117,953,663.59
其中：1.基金申购款	62,511.03	12,393.99	74,905.02
2.基金赎回款	-89,187,862.35	-28,840,706.26	-118,028,568.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	379,893,712.49	52,278,124.75	432,171,837.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：陈重，主管会计工作负责人：张宗友，会计机构负责人：徐端骞

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

新华精选低波动股票型证券投资基金由新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型而成。

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2014 年 4 月 2 日经中国证监会证监许可[2014]351 号文准予募集注册，基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。新华鑫安保本一号混合型证券投资基金自 2014 年 5 月 26 日至 2014 年 6 月 13 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会机构部函[2014]552 号确认，《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 18 日生效。

根据《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》的约定，保本周期届满时，若新华鑫安保本一号混合型证券投资基金未能符合保本基金存续条件，则转型为非保本的股票型证券投资基

金，基金名称相应变更为“新华精选低波动股票型证券投资基金”。新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2018 年 1 月 26 日第三个保本周期到期不符合保本基金存续条件，2018 年 2 月 3 日起新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型为新华精选低波动股票型证券投资基金，《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》生效。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为 80—95%，其中投资于本基金界定的低波动率股票的比例不低于非现金资产的 80%，债券投资占基金资产的比例范围为 0—20%；本基金保持现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2018 年 8 月 28 日批准报出。

6.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告一致。

6.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 2 月 3 日至 2018 年 6 月 30 日。

6.1.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应

收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

除衍生工具所产生的金融负债外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以成本进行后续计量,在摊销时产生的利得或损失,应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产;金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,终止确认该金融负

债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

（2）债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息（作为应收利息单独核算）。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

（3）权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

（4）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算。

(5) 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。

买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

(6) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。

存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

(2) 主要资产的估值方法

①股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

②债券投资

对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种（含上交所可交换债），选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值净价作为公允价值。

对在交易所市场上市交易的可转换债券（含深交所可交换债券），采用交易所每日收盘价（估值全价）扣减上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券、私募债券和未上市债券，采用成本估值。

对于银行间市场上的固定收益品种，选取中国债券登记结算有限公司提供的相应品种当日的估值净价加上上一起息日至估值日每百元债券的税前应计利息（算头算尾）减去上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

③如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

6.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于月末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

（3）公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

6.1.4.4.10 费用的确认和计量

（1）基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提；

- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提;
- (3) 基金销售服务费 (C 级) 按前一日基金 C 级资产净值 0.20%年费率计提;
- (4) 卖出回购金融资产支出, 按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率 (当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率) 在回购期内逐日计提;
- (5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定, 按实际支出金额, 列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的, 则采用待摊或预提的方法。

6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 每一基金份额享有同等的分配权;
- (2) 在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金每年收益分配次数最多为 12 次, 每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%, 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;
- (3) 本基金收益分配方式分两种: 现金分红与红利再投资, 投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资; 若投资者不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红;
- (4) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值; 即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。
- (5) 基金红利发放日距离收益分配基准日 (即可供分配利润计算截至日) 的时间不得超过 15 个工作日;
- (6) 法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.1.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准, 财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起, 调整证券 (股票) 交易印

花税征收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》的规定：2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定：对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 号）、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140 号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2 号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56 号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90 号）的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，证券投资基金在运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照现行规定缴纳增值税及附加税费。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%

计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时，对个人持股 1 年以内（含 1 年）的，上市公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2018年6月30日
活期存款	16,086,923.36
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	16,086,923.36

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2018年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	224,424,849.81	212,619,702.30	-11,805,147.51	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	59,975,240.00	60,124,000.00	148,760.00
	合计	59,975,240.00	60,124,000.00	148,760.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	284,400,089.81	272,743,702.30	-11,656,387.51	

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

- 1、本基金本报告期无金融衍生工具投资。
- 2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
银行买市场	110,240,415.13	-
固收平市场	43,200,000.00	-
合计	153,440,415.13	-

1、本基金本报告期无买断式回购。

2、本基金转型日为 2018 年 2 月 3 日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,393.01
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,008.81
应收债券利息	1,073,945.20
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	38,626.09
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,115,973.11

注：1、应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

2、本基金转型日为 2018 年 2 月 3 日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.6 其他资产

1、本基金报告期末无其他资产。

2、本基金转型日为 2018 年 2 月 3 日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,896,087.18
银行间市场应付交易费用	20,973.85
合计	1,917,061.03

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	-
预提费用	228,108.87
合计	228,108.87

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	585,855,385.12	469,019,063.81
本期申购	78,084.26	62,511.03
本期赎回（以“-”号填列）	-111,394,558.39	-89,187,862.35
本期末	474,538,910.99	379,893,712.49

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期初	151,438,394.50	2,244,098.76	153,682,493.26
本期利润	-60,919,668.73	-11,656,387.51	-72,576,056.24
本期基金份额交易产生的变动数	-28,414,521.73	-413,790.54	-28,828,312.27
其中：基金申购款	12,452.77	-58.78	12,393.99

基金赎回款	-28,426,974.50	-413,731.76	-28,840,706.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,104,204.04	-9,826,079.29	52,278,124.75

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
活期存款利息收入	191,213.22
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	23,528.03
其他	-
合计	214,741.25

注：1、结算备付金利息收入包含保证金利息收入。

2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.12 股票投资收益

6.1.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	984,040,774.98
减：卖出股票成本总额	1,044,375,598.22
买卖股票差价收入	-60,334,823.24

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	216,789,746.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	215,189,086.58

减：应收利息总额	1,377,632.88
买卖债券差价收入	223,026.58

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.14 资产支持证券投资收益

- 1、本基金本报告期内无资产支持证券投资。
- 2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.15 贵金属投资收益

- 1、本基金本报告期无贵金属投资。
- 2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.16 衍生工具收益

- 1、本基金本报告期无衍生工具投资。
- 2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,187,737.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,187,737.30

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-11,656,387.51
——股票投资	-11,805,147.51
——债券投资	148,760.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-

3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-11,656,387.51

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
基金赎回费收入	161.54
合计	161.54

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	3,045,005.23
银行间市场交易费用	2,637.50
合计	3,047,642.73

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
审计费	32,438.64
信息披露费	154,081.32
债券账户维护费	9,300.00
汇划手续费	32,554.16
其他	0.00
合计	228,374.12

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.1.4.8.1 或有事项

截止 2018 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.1.4.9 关联方关系

6.1.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.1.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

注：本基金转型日为 2018 年 2 月 3 日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.10.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年2月3日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
恒泰证券股份有限 公司	288,839,231.41	12.83%

注：本基金转型日为 2018 年 2 月 3 日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.10.2 权证交易

本基金报告期末未运用关联方交易单元进行权证交易。

6.1.4.10.3 债券交易

- 1、本基金报告期末未运用关联方交易单元进行债券交易。
- 2、本基金转型日为 2018 年 2 月 3 日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.10.4 债券回购交易

- 1、本基金报告期末未运用关联方交易单元进行债券回购交易。
- 2、本基金转型日为 2018 年 2 月 3 日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.10.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年2月3日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
恒泰证券股份有限公 司	266,471.55	14.32%	108,731.22	5.73%

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示；

2、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

3、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.10.6 关联方报酬

6.1.4.10.6.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,865,077.06
其中：支付销售机构的客户维护费	6,302.85

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值1.5%年费率计提。管理费的计算方法为：每日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.10.6.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	382,010.27

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：每日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.10.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

1、本基金未与关联方进行银行间债券（含回购）交易。

2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.10.7 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年2月3日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	16,086,923.36	191,213.22

注：本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.10.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

- 1、本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。
- 2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.10.9 其他关联交易事项的说明

6.1.4.10.9.1 其他关联交易事项的说明

- 1、本基金本报告期内无其他关联交易事项。
- 2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.11 利润分配情况

- 1、本基金本报告期无收益分配事项。
- 2、本基金转型日为2018年2月3日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.1.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	网下中签	9.00	9.00	5,384.00	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	网下中签	13.09	13.09	1,765.00	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	网下中签	4.83	4.83	3,410.00	16,470.30	16,470.30	-

6.1.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

- 1、本基金报告期无银行间债券正回购余额。
- 2、本基金转型日为 2018 年 2 月 3 日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

- 1、本基金报告期无交易所债券正回购余额。
- 2、本基金转型日为 2018 年 2 月 3 日，截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.13 金融工具风险及管理

6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.1.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-

未评级	60,124,000.00
合计	60,124,000.00

6.1.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	-
合计	-

6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.1.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

6.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
银行存款	16,086,923.36	-	-	-	16,086,923.36
结算备付金	1,763,221.09	-	-	-	1,763,221.09
存出保证金	727,874.53	-	-	-	727,874.53
交易性金融资产	60,124,000.00	-	-	212,619,702.30	272,743,702.30
买入返售金融资产	153,440,415.13	-	-	-	153,440,415.13
应收证券清算款	-	-	-	5,540,937.53	5,540,937.53
应收利息	-	-	-	1,115,973.11	1,115,973.11
应收申购款	-	-	-	998.50	998.50
资产总计	232,142,434.11	-	-	219,277,611.44	451,420,045.55
应付证券清算款	-	-	-	16,472,123.92	16,472,123.92
应付管理人报酬	-	-	-	553,093.39	553,093.39
应付托管费	-	-	-	73,745.76	73,745.76
应付交易费用	-	-	-	1,917,061.03	1,917,061.03
应付税费	-	-	-	4,075.34	4,075.34
其他负债	-	-	-	228,108.87	228,108.87
负债总计	-	-	-	19,248,208.31	19,248,208.31
利率敏感度缺口	232,142,434.11	-	-	200,029,403.13	432,171,837.24

6.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点	
	其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2018年6月30日
	市场利率上升 25.00 bp	-51,356.15
	市场利率下降 25.00 bp	51,484.70

注：本基金管理人运用 XRisk Suite 风险控制系统对本基金投资组合中的银行存款、结算备付金、存出保证金和债券类资产做出以上利率风险的敏感性分析。

6.1.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.1.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	212,619,702.30	49.20
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	60,124,000.00	13.91
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	272,743,702.30	63.11

6.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假 设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升 1%	
	其他市场变量不变,沪深 300 指数下降 1%	
分 析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2018年6月30日
	沪深 300 指数上升 1%	2,156,526.23
	沪深 300 指数下降 1%	-2,156,526.23

注：本基金管理人运用 XRisk suite 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价格风险的敏感性分析。

6.2 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

6.2.1 资产负债表

会计主体：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

报告截止日：2018年2月2日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年2月2日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款	6.2.4.7.1	436,024,714.59	236,952,230.09
结算备付金		789,507.97	2,559,227.66
存出保证金		912,574.50	636,539.90
交易性金融资产	6.2.4.7.2	-	1,007,411,292.76
其中: 股票投资		-	288,895,344.36
基金投资		-	-
债券投资		-	718,515,948.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	247,008,763.51	331,161,307.74
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.2.4.7.5	156,951.20	12,008,069.52
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		684,892,511.77	1,590,728,667.67
负债和所有者权益		本期末 2018年2月2日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		34,914,667.41	672,871.83
应付管理人报酬		24,952,226.79	269,148.73
应付托管费		228,942.10	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.2.4.7.6	1,858,883.48	1,598,980.78
应交税费		14,646.01	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.2.4.7.7	221,588.91	460,000.00
负债合计		62,190,954.70	3,001,001.34
所有者权益：		-	-
实收基金	6.2.4.7.8	469,019,063.81	1,200,810,015.08
未分配利润	6.2.4.7.9	153,682,493.26	386,917,651.25
所有者权益合计		622,701,557.07	1,587,727,666.33
负债和所有者权益总计		684,892,511.77	1,590,728,667.67

注：报告截止日 2018 年 2 月 2 日，基金份额净值 1.0630 元，基金份额 585,855,385.12 份。

6.2.2 利润表

会计主体：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 2 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 2 日	
一、收入	-	32,295,466.17	
1.利息收入	-	5,210,101.96	
其中：存款利息收入	-	342,964.91	
债券利息收入	-	2,661,696.81	
资产支持证券利息收入	-	-	
买入返售金融资产收入	-	2,205,440.24	
其他利息收入	-	-	
2.投资收益（损失以“-”填列）	-	34,756,684.21	
其中：股票投资收益	-	34,316,190.06	
基金投资收益	-	-	
债券投资收益	-	446,780.06	
资产支持证券投资收益	-	-	
贵金属投资收益	-	-	
衍生工具收益	-	-	
股利收益	-	-6,285.91	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-7,671,320.00	
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-	
减：二、费用	-	26,116,923.29	
1. 管理人报酬	-	24,952,226.79	

2. 托管费	-	228,942.10
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	-	874,242.77
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	1,569.22
7. 其他费用	-	59,942.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	6,178,542.88
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	6,178,542.88

6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年2月2日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,200,810,015.08	386,917,651.25	1,587,727,666.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,178,542.88	6,178,542.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-731,790,951.27	-239,413,700.87	-971,204,652.14
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-731,790,951.27	-239,413,700.87	-971,204,652.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	469,019,063.81	153,682,493.26	622,701,557.07
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,200,810,015.08	313,284,198.80	1,514,094,213.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	45,328,962.69	45,328,962.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,200,810,015.08	358,613,161.49	1,559,423,176.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：陈重，主管会计工作负责人：张宗友，会计机构负责人：徐端骞

6.2.4 报表附注

6.2.4.1 基金基本情况

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]351号文件《关于核准新华鑫安保本一号混合型证券投资基金募集的批复》批准，由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于2014年5月26日至6月13日向社会公开募集，首次募集资金总额527,969,641.22元，其中募集资金产生利息203,567.11元，并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2014]37100022号验资报告予以验证。2014年6月18日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不限定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金以定期开放的方式运作，即在基金保本周期内采取封闭式运作（保本周期到期日除外），期间不开放申购、赎回及转换转入转出业务；到期操作期间开放赎回和转换转出业务，不开放申购和转换转入业务；过渡期只可进行过渡期申购，不开放赎回、转换转出业务。

本基金保本周期最长为十八个月，在每一保本周期内均设置该保本周期的目标收益率，在保本

周期内，如本基金份额净值累计收益率连续 5 个工作日达到或超过预设目标收益率，则基金管理人将在满足条件之日起 10 个工作日内公告本基金当前保本周期提前到期（提前到期日距离满足条件之日起不超过 20 个工作日），并进入到到期操作期间。到期操作期间截止日次一工作日（含该日）起至下一保本周期开始日前一工作日（含该日）的时间为过渡期，最长不超过 20 个工作日；在过渡期最后一个工作日本基金份额净值折算为 1.000 元。过渡期结束后，本基金将进入下一保本周期，同时重新开始计算下一保本周期的目标收益率。

根据《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金将转型为非保本的股票型证券投资基金，基金名称相应变更为“新华精选低波动股票型证券投资基金”。

根据《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包含国债、央票、政策性金融债及所有非国家信用的固定收益类金融工具）、股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证、资产支持证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的相关规定）。本基金将依照投资组合保本策略将基金资产配置于固定收益资产与风险资产：固定收益资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据、政策性金融债、企业债、中小企业私募债券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、短期融资券、中期票据、资产支持证券等）、债券回购、货币市场工具和银行存款等固定收益资产；风险资产为股票、权证等权益类资产；本基金不参与定向增发。本基金的投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等固定收益资产占基金资产的比例不低于 60%。在每个到期操作期间的前 3 个月、到期操作期间、过渡期及过渡期的后 3 个月不受前述投资组合比例的限制；在到期操作期间和过渡期，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，在保本周期内（保本周期到期日除外），本基金不受该比例的限制。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。本基金的业绩比较标准为： $1.5 \times$ （一年期银行定期存款税后收益率+1%）。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2018 年 8 月 28 日批准报出。

6.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布

的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.2.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税征收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1%的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1%的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》的规定：2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免

征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定：对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36号）、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90号）的规定，自2018年1月1日起，证券投资基金在运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照现行规定缴纳增值税及附加税费。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%

计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时，对个人持股1年以内（含1年）的，上市公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年2月2日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	436,024,714.59	-
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-

其他存款	-	-
合计	436,024,714.59	236,952,230.09

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.2 衍生金融资产/负债

- 1、本基金本报告期无金融衍生工具投资。
- 2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.3 买入返售金融资产

6.2.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年2月2日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
银行买市场	247,008,763.51	-
固收平市场	-	-
合计	247,008,763.51	-

6.2.4.7.3.2 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年2月2日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行买市场	247,008,763.51	-
固收平市场	-	-
合计	247,008,763.51	-

- 1、本基金本报告期无买断式回购。
- 2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年2月2日
应收活期存款利息	134,353.97
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,939.33
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	16,657.90
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	156,951.20

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2018 年 2 月 3 日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.5 其他资产

1、本基金报告期末无其他资产。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2018 年 2 月 3 日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年2月2日
交易所市场应付交易费用	1,842,900.09
银行间市场应付交易费用	15,983.39
合计	1,858,883.48

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2018 年 2 月 3 日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2018年2月2日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	-
预提费用	221,588.91
合计	221,588.91

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,499,500,402.73	1,200,810,015.08
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-913,645,017.61	-731,790,951.27
本期末	585,855,385.12	469,019,063.81

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期初	373,523,921.34	13,393,729.91	386,917,651.25
本期利润	13,849,862.88	-7,671,320.00	6,178,542.88
本期基金份额交易产生的变动数	-235,935,389.72	-3,478,311.15	-239,413,700.87
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-235,935,389.72	-3,478,311.15	-239,413,700.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	151,438,394.50	2,244,098.76	153,682,493.26

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2日
活期存款利息收入	125,963.50
定期存款利息收入	212,500.18
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,501.23
其他	-
合计	342,964.91

注：1、结算备付金利息收入包含保证金利息收入。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2日
卖出股票成交总额	402,268,802.68
减：卖出股票成本总额	367,952,612.62
买卖股票差价收入	34,316,190.06

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,359,100,192.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,343,081,889.02
减：应收利息总额	15,571,522.93
买卖债券差价收入	446,780.06

6.2.4.7.13 资产支持证券投资收益

1、本基金本报告期内无资产支持证券投资。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.14 贵金属投资收益

1、本基金本报告期无贵金属投资。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.15 衍生工具收益

1、本基金本报告期无衍生工具投资。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2日
股票投资产生的股利收益	-6,285.91
基金投资产生的股利收益	-
合计	-6,285.91

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2日
1.交易性金融资产	-7,671,320.00
——股票投资	-7,788,608.56
——债券投资	117,288.56
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动	-

产生的预估增值税	
合计	-7,671,320.00

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2018 年 2 月 3 日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 2 日
交易所市场交易费用	870,370.02
银行间市场交易费用	3,872.75
合计	874,242.77

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2018 年 2 月 3 日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年2月2日
审计费	7,232.94
信息披露费	34,355.97
债券账户维护费	9,000.00
汇划手续费	8,739.50
其他	614.00
合计	59,942.41

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2018 年 2 月 3 日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.2.4.8.1 或有事项

截止 2018 年 2 月 2 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

截止 2018 年 2 月 2 日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.2.4.9 关联方关系

6.2.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.2.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年2月2日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	65,910,460.58	13.48%	8,968,954.82	0.69%

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10.1.2 权证交易

1、本基金报告期末未运用关联方交易单元进行权证交易。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10.1.3 债券交易

1、本基金报告期末未运用关联方交易单元进行债券交易。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10.1.4 债券回购交易

- 1、本基金报告期末运用关联方交易单元进行债券回购交易。
- 2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年2月2日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
恒泰证券股份有限公司	61,381.66	14.45%	97,120.72	2.27%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
恒泰证券股份有限公司	8,335.15	0.77%	8,270.14	0.83%

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示；

2、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

3、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10.2 关联方报酬

6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月 2日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	24,952,226.79
其中：支付销售机构的客户维护费	117,203.78	1,133,035.59

注：本基金采取固定及浮动相结合的管理费收取方式。即本基金在保本周期内收取固定管理费，在保本周期到期日收取浮动管理费。

1、本基金的固定管理费按前一日资金资产净值0.5%年费率计提。固定管理费的计算方法为：

每日基金管理费=前一日基金资产净值×0.5%÷当年天数。

2、本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

3、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年2月2日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	228,942.10	1,519,881.85

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
每日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

1、本基金未与关联方进行银行间债券（含回购）交易。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年2月2日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	436,024,714.59	21,816.41	16,404,092.79	95,700.73

注：新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.10.6 其他关联交易事项的说明

6.2.4.10.6.1 其他关联交易事项的说明

1、本基金本报告期内无其他关联交易事项。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.11 利润分配情况

1、本基金本报告期无收益分配事项。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.12 期末（2018年2月2日）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有流通受限证券。

6.2.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

1、本基金报告期无银行间债券正回购余额。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

1、本基金报告期无交易所债券正回购余额。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.13 金融工具风险及管理

6.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系

6.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.2.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年2月2日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

6.2.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年2月2日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	8,459,461.90
AAA 以下	-	-
未评级	-	7,985,486.50
合计	-	16,444,948.40

6.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余

额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.2.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

6.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年2月2日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	436,024,714.59	-	-	-	436,024,714.59
结算备付金	789,507.97	-	-	-	789,507.97
存出保证金	912,574.50	-	-	-	912,574.50
买入返售金融资产	247,008,763.51	-	-	-	247,008,763.51
应收利息	-	-	-	156,951.20	156,951.20
资产总计	684,735,560.57	-	-	156,951.20	684,892,511.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	34,914,667.41	34,914,667.41
应付管理人报酬	-	-	-	24,952,226.79	24,952,226.79
应付托管费	-	-	-	228,942.10	228,942.10
应付交易费用	-	-	-	1,858,883.48	1,858,883.48

应付税费	-	-	-	14,646.01	14,646.01
其他负债	-	-	-	221,588.91	221,588.91
负债总计	-	-	-	62,190,954.70	-
利率敏感度缺口	684,735,560.57	-	-	-62,034,003.50	622,701,557.07
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
银行存款	236,952,230.09	-	-	-	236,952,230.09
结算备付金	2,559,227.66	-	-	-	2,559,227.66
存出保证金	636,539.90	-	-	-	636,539.90
交易性金融资产	718,515,948.40	-	-	288,895,344.36	1,007,411,292.76
买入返售金融资产	331,161,307.74	-	-	-	331,161,307.74
应收利息	-	-	-	12,008,069.52	12,008,069.52
资产总计	1,289,825,253.79	-	-	300,903,413.88	1,590,728,667.67
应付管理人报酬	-	-	-	672,871.83	672,871.83
应付托管费	-	-	-	269,148.73	269,148.73
应付交易费用	-	-	-	1,598,980.78	1,598,980.78
其他负债	-	-	-	460,000.00	460,000.00
负债总计	-	-	-	3,001,001.34	3,001,001.34
利率敏感度缺口	1,289,825,253.79	-	-	297,902,412.54	1,587,727,666.33

6.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.2.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.2.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格

风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年2月2日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	288,895,344.36	18.20
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	718,515,948.40	45.25
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	-	-	1,007,411,292.76	63.45

6.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升 1%		
	其他市场变量不变,沪深 300 指数下降 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2018年2月2日	上年度末 2017年12月31日
	沪深 300 指数上升 1%	-	1,373,074.98
	沪深 300 指数下降 1%	-	-1,373,074.98

注：本基金管理人运用 XRisk suite 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价格风险的敏感性分析。

7 投资组合报告

7.1 新华精选低波动股票型证券投资基金

(报告期：2018年2月3日-2018年6月30日)

7.1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	212,619,702.30	47.10
	其中：股票	212,619,702.30	47.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,124,000.00	13.32
	其中：债券	60,124,000.00	13.32
	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	153,440,415.13	33.99
	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	17,850,144.45	3.95
8	其他各项资产	7,385,783.67	1.64
9	合计	451,420,045.55	100.00

7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1 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	37,720,361.00	8.73
C	制造业	50,833,009.39	11.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,018,903.85	6.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	12,225,166.72	2.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,812,606.00	6.20
J	金融业	31,778,444.00	7.35
K	房地产业	17,780,313.20	4.11
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	81,226.14	0.02
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	8,369,672.00	1.94
S	综合	-	-
T	合计	212,619,702.30	49.20

7.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	1,669,600	26,947,344.00	6.24
2	600028	中国石化	2,858,700	18,552,963.00	4.29
3	601318	中国平安	214,500	12,565,410.00	2.91
4	600377	宁沪高速	1,346,384	12,225,166.72	2.83
5	001979	招商蛇口	619,544	11,802,313.20	2.73
6	600030	中信证券	680,700	11,279,199.00	2.61
7	300059	东方财富	828,100	10,914,358.00	2.53
8	601225	陕西煤业	1,302,600	10,707,372.00	2.48
9	002153	石基信息	345,297	10,013,613.00	2.32
10	600660	福耀玻璃	382,800	9,841,788.00	2.28
11	600019	宝钢股份	1,120,900	8,731,811.00	2.02
12	600188	兖州煤业	648,775	8,460,026.00	1.96
13	600977	中国电影	521,800	8,369,672.00	1.94
14	601601	中国太保	249,100	7,933,835.00	1.84
15	300408	三环集团	326,400	7,670,400.00	1.77
16	600585	海螺水泥	211,300	7,074,324.00	1.64
17	603228	景旺电子	131,100	6,481,584.00	1.50
18	600048	保利地产	490,000	5,978,000.00	1.38
19	300166	东方国信	399,500	5,884,635.00	1.36
20	600031	三一重工	500,429	4,488,848.13	1.04
21	000338	潍柴动力	501,700	4,389,875.00	1.02
22	600887	伊利股份	74,800	2,086,920.00	0.48
23	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.02
24	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
25	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.01
26	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
27	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600900	长江电力	46,283,938.30	10.71
2	601318	中国平安	45,086,401.84	10.43
3	600028	中国石化	36,849,969.95	8.53
4	600036	招商银行	29,586,621.09	6.85
5	001979	招商蛇口	28,248,535.44	6.54
6	600660	福耀玻璃	24,950,362.08	5.77
7	601328	交通银行	24,406,009.00	5.65
8	600606	金丰投资	23,335,281.00	5.40
9	601006	大秦铁路	22,899,524.40	5.30
10	601088	中国神华	22,587,644.36	5.23
11	601939	建设银行	20,500,396.86	4.74
12	601398	工商银行	20,391,920.00	4.72
13	601336	新华保险	20,319,085.70	4.70
14	600585	海螺水泥	19,653,060.00	4.55
15	601988	中国银行	19,525,168.00	4.52
16	600377	宁沪高速	18,705,019.61	4.33
17	600019	宝钢股份	18,237,120.50	4.22
18	600004	白云机场	17,096,476.79	3.96
19	002142	宁波银行	16,573,265.60	3.83
20	000002	万科A	16,197,220.00	3.75

注：本项“买入金额”均按买入成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	28,906,132.58	6.69
2	600036	招商银行	28,211,971.55	6.53
3	601328	交通银行	23,216,277.00	5.37
4	600606	绿地控股	21,870,887.50	5.06
5	601006	大秦铁路	21,578,340.60	4.99
6	601088	中国神华	20,273,075.48	4.69
7	600900	长江电力	18,977,490.00	4.39
8	601988	中国银行	18,211,074.00	4.21
9	600028	中国石化	18,160,209.32	4.20

10	601398	工商银行	17,822,827.00	4.12
11	601336	新华保险	17,519,310.00	4.05
12	600004	白云机场	17,236,824.75	3.99
13	601939	建设银行	17,198,128.00	3.98
14	600519	贵州茅台	15,944,381.74	3.69
15	002142	宁波银行	15,625,589.57	3.62
16	000961	中南建设	14,683,118.30	3.40
17	000002	万科A	14,489,383.22	3.35
18	600660	福耀玻璃	14,077,270.24	3.26
19	601169	北京银行	13,972,286.88	3.23
20	600018	上港集团	13,810,685.00	3.20

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,268,800,448.03
卖出股票的收入（成交）总额	984,040,774.98

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,000,000.00	4.63
	其中：政策性金融债	20,000,000.00	4.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,124,000.00	9.28
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	其他	-	-
9	合计	60,124,000.00	13.91

7.1.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例(%)
1	011800589	18 京粮 SCP002	400,000	40,124,000.00	9.28
2	170207	17 国开 07	200,000	20,000,000.00	4.63

7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

7.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.1.9 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

本基金本报告期末无权证投资。

7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.1.12 本报告期投资基金情况

7.1.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末无基金投资。

7.1.13 投资组合报告附注

7.1.13.1 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。

7.1.13.2 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

7.1.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	727,874.53
2	应收证券清算款	5,540,937.53
3	应收股利	-
4	应收利息	1,115,973.11
5	应收申购款	998.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,385,783.67

7.1.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券投资。

7.1.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末前十名股票中不存在流通受限股票。

7.2 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

(报告期：2018年1月1日-2018年2月2日)

7.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	247,008,763.51	36.07
	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	436,814,222.56	63.78
8	其他各项资产	1,069,525.70	0.15
9	合计	684,892,511.77	100.00

7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末持有股票。

7.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	19,535,164.61	1.23
2	600004	白云机场	15,847,661.71	1.00
3	000537	广宇发展	8,859,298.00	0.56
4	601998	中信银行	7,932,480.60	0.50
5	002142	宁波银行	7,924,222.70	0.50
6	600900	长江电力	6,456,321.00	0.41
7	000961	中南建设	6,443,442.00	0.41
8	601088	中国神华	5,902,050.00	0.37
9	600036	招商银行	4,741,860.00	0.30
10	002597	金禾实业	3,203,376.20	0.20

注：本项"买入金额"均按买入成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.2.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	51,075,311.10	3.22
2	601939	建设银行	38,434,779.20	2.42
3	600036	招商银行	28,369,785.00	1.79
4	000651	格力电器	26,584,344.24	1.67
5	601601	中国太保	23,459,831.43	1.48
6	002142	宁波银行	17,841,980.60	1.12
7	600004	白云机场	16,673,920.30	1.05
8	601398	工商银行	16,291,832.65	1.03
9	601088	中国神华	15,814,650.88	1.00
10	600690	青岛海尔	14,572,462.92	0.92
11	600276	恒瑞医药	13,550,795.33	0.85
12	000333	美的集团	13,508,822.00	0.85
13	600519	贵州茅台	10,746,547.88	0.68
14	601336	新华保险	10,671,518.00	0.67
15	000895	双汇发展	10,371,309.48	0.65
16	600660	福耀玻璃	9,636,376.36	0.61
17	000537	广宇发展	9,433,784.87	0.59
18	601998	中信银行	8,538,494.73	0.54
19	000538	云南白药	8,040,638.00	0.51
20	000002	万科A	8,004,967.76	0.50

注：本项"卖出金额"均按卖出成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	86,845,876.82
卖出股票的收入（成交）总额	402,268,802.68

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

7.2.6 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

本基金本报告期末无债券投资。

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

7.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.2.9 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

本基金本报告期末无权证投资。

7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.2.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.2.12 本报告期投资基金情况

7.2.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末无基金投资。

7.2.13 投资组合报告附注

7.2.13.1 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。

7.2.13.2 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

7.2.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	912,574.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	156,951.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,069,525.70

7.2.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券投资。

7.2.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无股票投资。

8 基金份额持有人信息

8.1 新华精选低波动股票型证券投资基金

(报告期：2018年2月3日-2018年6月30日)

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

			比例		比例
177	2,681,010.80	470,052,931.11	99.05%	4,485,979.88	0.95%

8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,593.62	0.00%

8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

8.2 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

（报告期：2018年1月1日-2018年2月2日）

8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
2,278	257,179.71	478,792,526.60	81.73%	107,062,858.52	18.27%

9 开放式基金份额变动

9.1 新华精选低波动股票型证券投资基金

（报告期：2018年2月3日-2018年6月30日）

单位：份

基金合同生效日（2018年2月3日）基金份额总额	585,855,385.12
本报告期期初基金份额总额	585,855,385.12

本报告期基金总申购份额	78,084.26
减：本报告期基金总赎回份额	111,394,558.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	474,538,910.99

9.2 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

(报告期：2018年1月1日-2018年2月2日)

单位：份

基金合同生效日(2014年6月18日)基金份额总额	527,969,641.22
本报告期期初基金份额总额	1,499,500,402.73
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	913,645,017.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	585,855,385.12

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2018年5月21日，沈健先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理。

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金由新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型而来，本报告期本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略及其他投资策略。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期未发生改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 新华精选低波动股票型证券投资基金

(报告期：2018年2月3日-2018年6月30日)

10.8.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	288,839,231.41	12.83%	266,471.55	14.32%	-
安信证券	1	185,484,928.51	8.24%	135,644.99	7.29%	-
华泰证券	1	181,178,010.77	8.05%	132,494.87	7.12%	-
中金证券	1	161,791,651.87	7.18%	150,674.82	8.10%	-
浙商证券	1	152,579,204.62	6.78%	111,581.97	6.00%	-
齐鲁证券	1	150,309,150.75	6.67%	139,983.06	7.52%	-
东吴证券	1	144,002,804.33	6.39%	105,309.70	5.66%	-
国泰君安	1	141,459,447.80	6.28%	131,741.48	7.08%	-
国金证券	1	133,802,906.96	5.94%	124,608.41	6.70%	-
天风证券	1	124,411,121.61	5.52%	90,981.86	4.89%	-
东兴证券	1	103,766,854.65	4.61%	75,885.08	4.08%	-
兴业证券	1	94,222,787.32	4.18%	87,749.71	4.71%	-
川财证券	1	71,359,763.53	3.17%	52,186.01	2.80%	-
中信建投	1	69,319,278.66	3.08%	50,693.33	2.72%	-
中信证券	2	63,986,349.15	2.84%	59,590.61	3.20%	-
信达证券	1	46,325,997.88	2.06%	33,878.24	1.82%	-

华创证券	2	42,923,659.93	1.91%	31,390.09	1.69%	-
光大证券	1	39,954,029.87	1.77%	37,209.19	2.00%	-
东方证券	1	37,114,798.51	1.65%	27,142.26	1.46%	-
申银万国	1	9,884,151.94	0.44%	9,205.14	0.49%	-
渤海证券	1	9,245,662.05	0.41%	6,761.36	0.36%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用34个交易席位，其中报告期内新增1个交易席位，新增交易席位为：华创证券上海交易席位，退租0个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经济商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

- 3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.8.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
齐鲁证券	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-

10.8.2 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

(报告期：2018年1月1日-2018年2月2日)

10.8.2.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	6,456,321.00	1.32%	4,721.49	1.11%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	53,827,233.97	11.01%	50,129.14	11.80%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	65,910,460.58	13.48%	61,381.66	14.45%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	138,202,516.23	28.26%	128,707.89	30.31%	-
浙商证券	1	12,692,069.75	2.59%	9,281.73	2.19%	-
齐鲁证券	1	21,086,094.25	4.31%	19,637.93	4.62%	-
东吴证券	1	113,625.16	0.02%	83.09	0.02%	-
国泰君安	1	34,450,858.92	7.04%	32,084.43	7.55%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	39,336,750.66	8.04%	28,767.20	6.77%	-
东兴证券	1	28,173,727.00	5.76%	20,603.23	4.85%	-
兴业证券	1	21,577,920.68	4.41%	20,095.38	4.73%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-

中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	3,543,200.91	0.72%	2,591.13	0.61%	-
华创证券	2	22,292,092.60	4.56%	16,302.30	3.84%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	41,451,807.79	8.47%	30,313.99	7.14%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用 34 个交易席位，其中报告期内新增 1 个交易席位，新增交易席位为：华创证券上海交易席位，退租 0 个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经济商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

- 3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.8.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	434,207.65	3.99%	-	-	-	-
恒泰证券	344,790.63	3.17%	-	-	-	-
齐鲁证券	488,306.70	4.48%	-	-	-	-
东兴证券	8,803,883.10	80.84%	-	-	-	-
东方证券	819,460.07	7.52%	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华基金管理股份有限公司关于旗下新华鑫安保本一号混合型证券投资基金保本周期到期安排及新华精选低波动股票型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
2	新华基金管理股份有限公司关于旗下新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
3	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
4	新华基金管理股份有限公司关于旗下新华鑫安保本一号混合型证券投资基金保本周期到期安排及新华精选低波动股票型证券投资基金转型运作后相关业务规则的第一次提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
5	关于旗下新华鑫安保本一号混合型证券投资基金保本周期到期安排及新华精选低波动股票型证券投资基金转型运作后相关业务规则的补充公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
6	新华基金管理股份有限公司关于旗下新华鑫安保本一号混合型证券投资基金保本周期到期安排及新华精选低波动股票型证券投资基金转型运作后相关业务规则的第一次提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-

7	新华基金管理股份有限公司关于旗下新华鑫安保本一号混合型证券投资基金保本周期到期安排及新华精选低波动股票型证券投资基金转型运作后相关业务规则的第二次提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
8	新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同	公司网站	-
9	新华精选低波动股票型证券投资基金托管协议	公司网站	-
10	新华精选低波动股票型证券投资基金招募说明书	公司网站	-
11	新华基金管理股份有限公司关于修订新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
12	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在北京展恒基金销售股份有限公司开展费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
13	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
14	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书（更新）全文	公司网站	-
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在北京恒天明泽基金销售有限公司开展费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
16	新华精选低波动股票型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
17	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金 2017 年年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
20	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加济安财富（北京）基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
21	新华精选低波动股票型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-

22	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
23	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加天津万家财富资产管理有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
24	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
25	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-
26	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金2018年半年度资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 新华精选低波动股票型证券投资基金

11.1.1 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	20180203-20180630	450,051,593.73	-	-	450,051,593.73	94.84%
产品特有风险							
<p>1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

11.2 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

11.2.1 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	20180101-20180202	450,051,593.73	-	-	450,051,593.73	76.82%
产品特有风险							
<p>1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

11.3 影响投资者决策的其他重要信息

新华精选低波动股票型证券投资基金由新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型而来，新华鑫安保本一号混合型证券投资基金第三个保本周期为2016年7月6日至2018年1月26日，在第三个保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，按《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的股票型证券投资基金，基金名称相应变更为“新华精选低波动股票型证券投资基金”，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。自2018年2月3日起，修订后的《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》生效，《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华鑫安保本一号混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 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
- (三) 新华精选低波动股票型证券投资基金托管协议

- (四) 新华精选低波动股票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) 《新华精选低波动股票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
- (十) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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

二〇一八年八月二十八日