

新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金
2018 年年度报告摘要
2018 年 12 月 31 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年三月二十八日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华泛资源优势混合
基金主代码	519091
交易代码	519091
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2009 年 7 月 13 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	258,856,033.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，通过重点精选与集中配置具有社会资源和自然资源（泛资源）优势的股票，实现基金净值增长,以求持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采用“自下而上”结合“自上而下”的投资策略，通过股票选择、行业配置，结合自上而下的战术性大类资产配置策略，进行积极投资管理。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数 + 40%×上证国债指数
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高等风险品种，预期风险和收益高于债券型、货币型基金，低于股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	郭明
	联系电话	010-68779688	010-66105799
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95588

传真	010-68779528	010-66105798
----	--------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-76,013,511.70	116,896,883.89	16,509,476.46
本期利润	-74,654,833.65	117,076,665.42	-1,334,425.34
加权平均基金份额本期利润	-0.3166	0.3619	-0.0122
本期基金份额净值增长率	-9.95%	20.41%	6.67%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	1.4440	1.7136	1.2543
期末基金资产净值	632,637,894.87	512,096,313.91	219,479,937.78
期末基金份额净值	2.444	2.714	2.254

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-4.87%	0.99%	-6.83%	0.98%	1.96%	0.01%
过去六个月	-6.82%	0.87%	-7.52%	0.90%	0.70%	-0.03%
过去一年	-9.95%	0.99%	-13.74%	0.80%	3.79%	0.19%
过去三年	15.66%	1.33%	-7.54%	0.71%	23.20%	0.62%
过去五年	117.63%	1.51%	30.69%	0.92%	86.94%	0.59%
自基金合同生效起至今	144.40%	1.33%	13.53%	0.91%	130.87%	0.42%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数，复合业绩比较基准为：60%*沪深 300 指数+40%*上证国债指数。

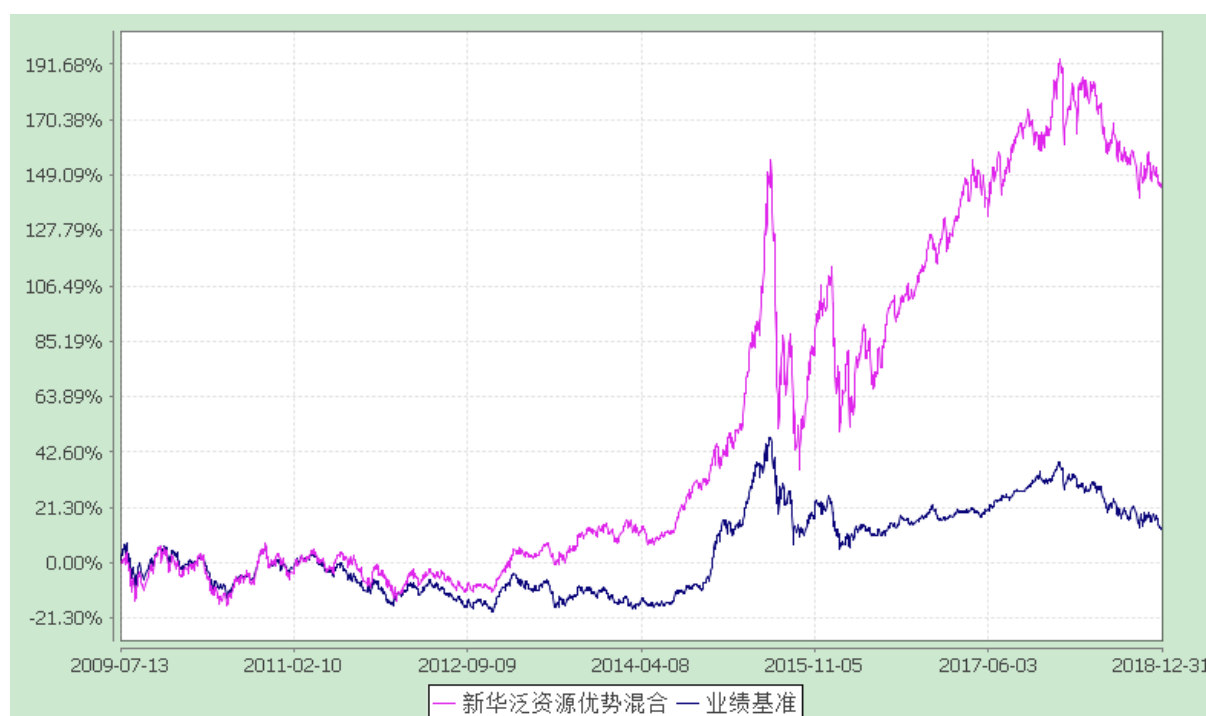
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2 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

新华泛资源优势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的历史走势对比图

(2009 年 7 月 13 日至 2018 年 12 月 31 日)

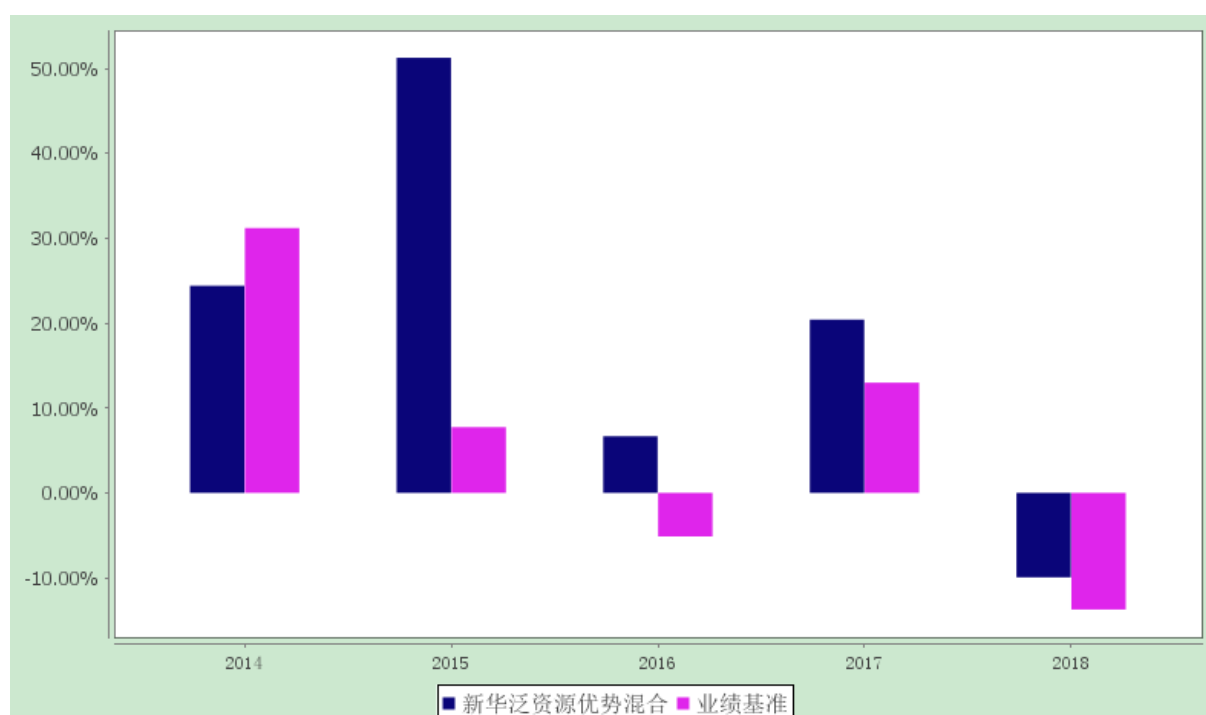


注：本基金于 2009 年 7 月 13 日基金合同生效。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

§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 12 月 31 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、新华安享惠钰定期开放债券型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债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		
栾超	本基金基金经理，新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理。	2018-05-17	-	6	经济学硕士，历任中邮创业基金管理股份有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。
栾江伟	本基金基金经理，新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华健康	2015-08-03	2018-05-28	9	硕士研究生，历任新华基金管理股份有限公司研究部行业研究员、基金经理。

	生活主题灵活配置混合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遵规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华泛资源优势灵活配置混合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》、《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定。

基金管理人旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明：债券同向交易频率偏低；股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断，即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大，结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，本报告期内，未发生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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年，国内资本市场先扬后抑，沪深 300 全年下跌 25.3%，市场多以结构性机会为主。本基金 2018 年出于防范风险，控制回撤的思路出发，整体维持中低仓位为主，配置上相对均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.444 元，本报告期份额净值增长率为-9.95%，同期比较基准的增长率为-13.74%。

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 2019 年，我国经济韧性强的基本面仍未改变，货币政策上看，去杠杆逐步取得成效后已进入稳杠杆阶段，货币政策对经济的支撑力度增强；财政政策上看，减税降费规模的扩大也表明财政政策更加积极，这些都有助于提高经济韧性和市场的风险偏好，市场有望迎来估值修复机会。同时，A 股国际化进程逐步加快，也将吸引海外投资者带来增量资金入市。我们对 2019 年市场整体机会偏乐观。操作上我们将在景气行业中自下而上寻找优质公司，以金融+科技创新为主线进行配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.7.1.1 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、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。

4.7.1.2 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。

4.7.1.3 投资管理部的职责分工

- 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。

4.7.1.4 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。

4.7.1.5 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部问讯；
- 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

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

§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

本报告期内，本基金托管人在对新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金的管理人——新华基金管理股份有限公司在新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资

资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新华基金管理股份有限公司编制和披露的新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2019 年 3 月 27 日

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 张伟胡慰签字出具了瑞华审字【2019】01360019 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：	-	-
银行存款	228,897,298.70	121,246,767.39
结算备付金	5,698,002.32	2,116,722.37
存出保证金	828,664.21	775,983.16
交易性金融资产	323,560,295.85	396,252,580.96
其中：股票投资	258,184,295.85	396,252,580.96

基金投资	-	-
债券投资	65,376,000.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	69,984,224.98	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,704,148.08	22,954.81
应收股利	-	-
应收申购款	25,276,989.63	1,993,869.77
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	656,949,623.77	522,408,878.46
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 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	19,829,704.77	3,898,880.51
应付赎回款	476,028.54	3,028,872.86
应付管理人报酬	787,431.73	671,979.84
应付托管费	131,238.64	111,996.66
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,456,947.75	1,960,380.38
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-

递延所得税负债	-	-
其他负债	630,377.47	640,454.30
负债合计	24,311,728.90	10,312,564.55
所有者权益：	-	-
实收基金	258,856,033.86	188,714,948.35
未分配利润	373,781,861.01	323,381,365.56
所有者权益合计	632,637,894.87	512,096,313.91
负债和所有者权益总计	656,949,623.77	522,408,878.46

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.444 元，基金份额总额 258,856,033.86 份。

7.2 利润表

会计主体：新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-48,772,093.03	146,807,108.58
1.利息收入	4,629,626.40	4,043,093.65
其中：存款利息收入	1,388,255.05	3,094,474.38
债券利息收入	2,615,145.21	230,827.39
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	626,226.14	717,791.88
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-55,294,229.31	140,820,496.44
其中：股票投资收益	-59,816,286.33	135,548,558.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-85,050.00
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	4,522,057.02	5,356,988.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,358,678.05	179,781.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	533,831.83	1,763,736.96
减：二、费用	25,882,740.62	29,730,443.16
1. 管理人报酬	9,407,302.76	12,255,485.78
2. 托管费	1,567,883.85	2,042,581.04
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	14,507,924.01	15,009,757.06
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	399,630.00	422,619.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-74,654,833.65	117,076,665.42
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-74,654,833.65	117,076,665.42

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	188,714,948.35	323,381,365.56	512,096,313.91

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-74,654,833.65	-74,654,833.65
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）	70,141,085.51	125,055,329.10	195,196,414.61
其中：1.基金申购款	220,548,092.30	393,813,628.77	614,361,721.07
2.基金赎回款	-150,407,006.79	-268,758,299.67	-419,165,306.46
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）	258,856,033.86	373,781,861.01	632,637,894.87
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	97,359,865.61	122,120,072.17	219,479,937.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	117,076,665.42	117,076,665.42
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）	91,355,082.74	84,184,627.97	175,539,710.71
其中：1.基金申购款	653,284,423.55	961,747,017.94	1,615,031,441.49
2.基金赎回款	-561,929,340.81	-877,562,389.97	-1,439,491,730.78

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）	188,714,948.35	323,381,365.56	512,096,313.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：陈重，主管会计工作负责人：张宗友，会计机构负责人：徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华泛资源优势灵活配置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[2009]384 号文件“关于核准新世纪泛资源优势灵活配置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 2009 年 6 月 2 日至 7 月 8 日向社会公开募集，首次募集资金总额 3,132,175,900.10 元，其中募集资金产生利息 531,078.20 元，并经万隆亚洲会计师事务所有限公司万亚会业字[2009]第 2453 号验资报告予以验证。2009 年 7 月 13 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华泛资源优势灵活配置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国内依法发行和上市的各类股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票的投资比例占基金资产的 30%—80%，其中投资于具有自然资源优势和社会资源优势的股票市值不低于股票投资的 80%；其它金融工具的投资比例占基金资产的 20%-70%，其中持有的现金和到期日在一年以内的政府债券的合计比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资占基金资产净值的 0%~3%。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。本基金的业绩比较基准为：60%*沪深 300 指数+ 40%*上证国债指数。

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 2019 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 42 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期末发生差错更正。

7.4.6 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、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、财税[2016]140 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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》：资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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。

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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
北京新华富时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	580,013,888.69	5.64%	2,002,724,723.04	19.21%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 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 12 月 31 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	424,166.16	5.04%	187,644.01	7.64%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	1,464,590.38	16.43%	156,663.64	7.99%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,407,302.76	12,255,485.78
其中：支付销售机构的客户维护费	2,101,879.00	3,078,470.68

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年
----	-----------------------	----------------------------

	12月31日	12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,567,883.85	2,042,581.04

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	228,897,298.70	1,299,055.70	121,246,767.39	1,129,147.07

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未参与关联方承销证券。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本	期末估值	备注

				限类 型				总额	总额	
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	网下中签	3.14	3.14	15,970.00	50,145.80	50,145.80	-
601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	限售股	13.77	10.97	527,300.00	7,260,921.00	5,784,481.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	10.03	-	-	385,476.00	5,603,839.00	3,866,324.28	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	3.80	2019-01-02	4.38	854,175.00	3,899,332.36	3,245,865.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	258,184,295.85	39.30
	其中：股票	258,184,295.85	39.30
2	固定收益投资	65,376,000.00	9.95
	其中：债券	65,376,000.00	9.95
	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	69,984,224.98	10.65
	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	234,595,301.02	35.71
7	其他各项资产	28,809,801.92	4.39
8	合计	656,949,623.77	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	6,680,000.00	1.06
C	制造业	70,439,592.78	11.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,721,370.00	2.17
F	批发和零售业	20,500,838.95	3.24
G	交通运输、仓储和邮政业	11,783,270.85	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,251,122.92	11.74
J	金融业	19,979,264.75	3.16

K	房地产业	21,779,865.00	3.44
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	6,860,000.00	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,188,970.60	1.93
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	258,184,295.85	40.81

8.3 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

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	300659	中孚信息	1,421,628	28,134,018.12	4.45
2	002129	中环股份	3,000,000	21,690,000.00	3.43
3	600861	北京城乡	2,949,761	20,500,838.95	3.24
4	300550	和仁科技	369,400	19,312,232.00	3.05
5	601939	建设银行	3,000,035	19,110,222.95	3.02
6	603019	中科曙光	400,000	14,352,000.00	2.27
7	601390	中国中铁	1,963,000	13,721,370.00	2.17
8	600048	保利地产	1,100,000	12,969,000.00	2.05
9	000063	中兴通讯	650,000	12,733,500.00	2.01
10	603377	东方时尚	834,861	12,188,970.60	1.93

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600048	保利地产	116,848,703.31	22.82
2	600703	三安光电	104,918,995.95	20.49

3	001979	招商蛇口	96,888,891.57	18.92
4	603019	中科曙光	91,867,424.18	17.94
5	000768	中航飞机	84,462,888.00	16.49
6	000002	万 科 A	82,996,745.82	16.21
7	002281	光迅科技	74,748,753.99	14.60
8	300567	精测电子	61,724,161.70	12.05
9	300137	先河环保	61,643,908.75	12.04
10	002129	中环股份	60,806,593.59	11.87
11	601939	建设银行	60,309,345.06	11.78
12	600808	马钢股份	60,201,775.84	11.76
13	002146	荣盛发展	59,543,622.40	11.63
14	601668	中国建筑	53,793,710.58	10.50
15	600760	中航沈飞	52,789,656.00	10.31
16	000651	格力电器	47,088,571.00	9.20
17	600498	烽火通信	45,549,595.41	8.89
18	000063	中兴通讯	45,258,701.16	8.84
19	600585	海螺水泥	44,650,984.15	8.72
20	000932	华菱钢铁	43,983,269.00	8.59
21	300659	中孚信息	42,737,529.65	8.35
22	600519	贵州茅台	41,907,556.08	8.18
23	000401	冀东水泥	41,622,829.15	8.13
24	300113	顺网科技	40,753,260.93	7.96
25	300170	汉得信息	38,280,473.50	7.48
26	600029	南方航空	36,230,745.25	7.07
27	600801	华新水泥	35,253,584.48	6.88
28	002916	深南电路	33,313,721.99	6.51
29	600482	中国动力	32,707,648.77	6.39
30	300383	光环新网	32,581,719.80	6.36
31	600879	航天电子	31,765,987.00	6.20
32	300188	美亚柏科	31,316,783.86	6.12
33	000661	长春高新	30,552,238.78	5.97
34	600383	金地集团	30,542,448.16	5.96
35	601336	新华保险	30,334,574.88	5.92
36	601636	旗滨集团	30,030,130.91	5.86
37	300159	新研股份	30,009,972.74	5.86
38	600581	八一钢铁	29,955,519.00	5.85
39	600019	宝钢股份	29,836,747.00	5.83
40	601318	中国平安	29,120,265.58	5.69
41	600600	青岛啤酒	28,979,828.95	5.66
42	300109	新开源	27,457,283.96	5.36
43	300601	康泰生物	27,351,195.32	5.34
44	601225	陕西煤业	26,480,985.24	5.17
45	000066	中国长城	26,243,332.47	5.12
46	000022	深赤湾 A	26,023,143.85	5.08

47	300450	先导智能	25,724,405.03	5.02
48	000402	金 融 街	25,504,955.24	4.98
49	300016	北陆药业	24,973,659.34	4.88
50	002396	星网锐捷	24,765,497.40	4.84
51	002271	东方雨虹	24,600,802.83	4.80
52	000089	深圳机场	24,291,527.97	4.74
53	600030	中信证券	24,181,064.00	4.72
54	600068	葛洲坝	23,651,224.00	4.62
55	002027	分众传媒	23,197,371.30	4.53
56	600183	生益科技	23,091,961.62	4.51
57	600893	航发动力	23,040,470.00	4.50
58	000039	中集集团	23,040,380.11	4.50
59	601992	金隅集团	22,955,285.07	4.48
60	600125	铁龙物流	21,649,745.48	4.23
61	600562	国睿科技	21,608,959.38	4.22
62	603848	好太太	21,339,011.46	4.17
63	601229	上海银行	21,036,654.50	4.11
64	000848	承德露露	21,012,816.76	4.10
65	603929	亚翔集成	20,630,348.00	4.03
66	600861	北京城乡	20,401,986.41	3.98
67	601117	中国化学	20,249,975.76	3.95
68	300037	新宙邦	20,039,551.99	3.91
69	601111	中国国航	19,970,514.00	3.90
70	300017	网宿科技	19,945,572.05	3.89
71	000672	上峰水泥	19,718,080.00	3.85
72	600583	海油工程	19,085,676.81	3.73
73	300623	捷捷微电	19,083,100.21	3.73
74	601390	中国中铁	18,964,854.28	3.70
75	600038	中直股份	18,331,887.00	3.58
76	601601	中国太保	17,720,365.11	3.46
77	002672	东江环保	17,713,349.88	3.46
78	300609	汇纳科技	17,677,902.80	3.45
79	300550	和仁科技	17,636,689.00	3.44
80	300166	东方国信	17,560,586.19	3.43
81	002410	广联达	17,535,956.26	3.42
82	002675	东诚药业	17,328,994.33	3.38
83	600196	复星医药	17,317,753.16	3.38
84	601328	交通银行	17,257,000.00	3.37
85	300203	聚光科技	17,147,106.56	3.35
86	600588	用友网络	17,141,747.81	3.35
87	600416	湘电股份	17,128,835.00	3.34
88	300687	赛意信息	16,939,400.20	3.31
89	000998	隆平高科	16,899,356.42	3.30
90	600690	青岛海尔	16,859,357.80	3.29

91	601288	农业银行	16,450,000.00	3.21
92	603729	龙韵股份	16,146,864.86	3.15
93	601800	中国交建	15,930,185.80	3.11
94	002698	博实股份	15,848,104.40	3.09
95	002912	中新赛克	15,670,601.38	3.06
96	002372	伟星新材	15,513,227.00	3.03
97	000786	北新建材	15,508,610.88	3.03
98	300059	东方财富	15,435,551.92	3.01
99	000606	顺利办	14,963,701.96	2.92
100	600073	上海梅林	14,723,058.89	2.88
101	600340	华夏幸福	14,672,633.26	2.87
102	600360	华微电子	14,574,681.95	2.85
103	601011	宝泰隆	14,446,350.00	2.82
104	600990	四创电子	14,215,501.00	2.78
105	300348	长亮科技	14,120,547.09	2.76
106	002456	欧菲科技	13,848,154.04	2.70
107	002065	东华软件	13,823,435.43	2.70
108	300414	中光防雷	13,817,412.94	2.70
109	300699	光威复材	13,619,564.50	2.66
110	002544	杰赛科技	13,615,220.50	2.66
111	300747	锐科激光	13,607,149.42	2.66
112	600503	华丽家族	13,506,074.99	2.64
113	603365	水星家纺	13,342,528.00	2.61
114	002202	金风科技	13,270,798.55	2.59
115	000547	航天发展	13,236,063.68	2.58
116	600884	杉杉股份	13,166,341.24	2.57
117	300122	智飞生物	13,144,412.00	2.57
118	300454	深信服	13,114,969.12	2.56
119	600845	宝信软件	13,023,657.33	2.54
120	002321	华英农业	13,022,484.00	2.54
121	300253	卫宁健康	12,870,025.76	2.51
122	600438	通威股份	12,844,911.80	2.51
123	300347	泰格医药	12,646,429.16	2.47
124	600887	伊利股份	12,548,044.96	2.45
125	300624	万兴科技	12,504,143.77	2.44
126	601766	中国中车	12,352,435.00	2.41
127	603002	宏昌电子	12,301,256.00	2.40
128	002659	凯文教育	12,274,352.70	2.40
129	600036	招商银行	12,198,911.22	2.38
130	600495	晋西车轴	11,980,522.18	2.34
131	601333	广深铁路	11,967,106.00	2.34
132	002224	三力士	11,908,171.09	2.33
133	603659	璞泰来	11,693,331.29	2.28
134	601669	中国电建	11,629,849.97	2.27

135	000501	鄂武商 A	11,434,512.65	2.23
136	603297	永新光学	11,316,536.56	2.21
137	002007	华兰生物	11,275,287.84	2.20
138	601818	光大银行	11,264,639.00	2.20
139	600188	兖州煤业	11,216,065.65	2.19
140	002786	银宝山新	11,211,613.57	2.19
141	002171	楚江新材	11,119,713.00	2.17
142	300496	中科创达	11,092,240.35	2.17
143	603383	顶点软件	11,083,832.20	2.16
144	002308	威创股份	10,854,049.00	2.12
145	601998	中信银行	10,848,006.96	2.12
146	603377	东方时尚	10,826,867.35	2.11
147	000513	丽珠集团	10,818,442.90	2.11
148	000839	中信国安	10,677,491.50	2.09
149	300468	四方精创	10,598,999.00	2.07
150	300311	任子行	10,551,949.00	2.06
151	002268	卫 士 通	10,416,366.00	2.03
152	601138	工业富联	10,372,734.45	2.03
153	300287	飞利信	10,332,846.00	2.02
154	300199	翰宇药业	10,321,142.70	2.02
155	002341	新纶科技	10,290,716.64	2.01

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

8.4.2 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	600048	保利地产	140,425,535.42	27.42
2	001979	招商蛇口	108,367,137.57	21.16
3	600703	三安光电	103,620,540.38	20.23
4	002146	荣盛发展	91,994,952.48	17.96
5	000768	中航飞机	85,614,512.93	16.72
6	600760	中航沈飞	78,606,724.73	15.35
7	002281	光迅科技	78,336,946.72	15.30
8	000002	万 科 A	75,340,516.29	14.71
9	603019	中科曙光	74,676,908.24	14.58
10	000932	华菱钢铁	71,715,079.09	14.00
11	300137	先河环保	65,081,041.76	12.71
12	300567	精测电子	60,883,080.46	11.89
13	600808	马钢股份	59,007,728.31	11.52

14	600383	金地集团	58,543,487.31	11.43
15	601668	中国建筑	53,116,791.40	10.37
16	600498	烽火通信	48,144,573.14	9.40
17	000651	格力电器	47,760,948.74	9.33
18	600879	航天电子	46,711,192.08	9.12
19	600585	海螺水泥	45,018,779.22	8.79
20	000401	冀东水泥	42,518,613.20	8.30
21	600519	贵州茅台	42,445,752.78	8.29
22	601939	建设银行	39,420,421.56	7.70
23	300113	顺网科技	38,992,286.30	7.61
24	600801	华新水泥	37,741,434.77	7.37
25	002129	中环股份	37,499,961.97	7.32
26	600893	航发动力	36,624,683.17	7.15
27	600029	南方航空	36,106,273.00	7.05
28	600482	中国动力	35,931,253.25	7.02
29	300170	汉得信息	34,892,013.19	6.81
30	601952	苏垦农发	34,043,192.44	6.65
31	002916	深南电路	32,499,142.38	6.35
32	000063	中兴通讯	32,440,899.33	6.33
33	000661	长春高新	32,329,615.25	6.31
34	601318	中国平安	32,043,501.73	6.26
35	300159	新研股份	31,817,589.87	6.21
36	300188	美亚柏科	29,081,131.16	5.68
37	300383	光环新网	29,072,649.86	5.68
38	601336	新华保险	28,979,636.86	5.66
39	600019	宝钢股份	28,696,190.82	5.60
40	600581	八一钢铁	28,355,641.60	5.54
41	300109	新开源	28,291,597.78	5.52
42	601636	旗滨集团	27,581,476.88	5.39
43	002396	星网锐捷	27,562,069.00	5.38
44	600600	青岛啤酒	27,344,164.38	5.34
45	300601	康泰生物	26,422,622.54	5.16
46	000022	深赤湾 A	26,259,862.54	5.13
47	300450	先导智能	25,698,738.71	5.02
48	603848	好太太	25,509,583.53	4.98
49	000066	中国长城	25,498,232.10	4.98
50	000402	金融街	24,830,470.25	4.85
51	600030	中信证券	24,501,494.95	4.78
52	002271	东方雨虹	23,981,183.99	4.68
53	600183	生益科技	23,683,219.64	4.62
54	000039	中集集团	23,268,464.14	4.54
55	601992	金隅集团	23,190,091.48	4.53
56	600562	国睿科技	22,982,771.08	4.49
57	601225	陕西煤业	22,687,142.48	4.43

58	600416	湘电股份	22,273,085.00	4.35
59	600068	葛洲坝	21,827,197.00	4.26
60	300016	北陆药业	21,577,167.15	4.21
61	601229	上海银行	20,757,337.10	4.05
62	002027	分众传媒	20,600,355.20	4.02
63	600125	铁龙物流	20,597,813.75	4.02
64	000848	承德露露	20,307,996.76	3.97
65	300037	新宙邦	19,793,336.29	3.87
66	600038	中直股份	19,747,524.00	3.86
67	601111	中国国航	19,681,715.60	3.84
68	601117	中国化学	19,201,590.58	3.75
69	603365	水星家纺	19,120,560.00	3.73
70	300017	网宿科技	18,859,733.52	3.68
71	002672	东江环保	18,800,622.32	3.67
72	603729	龙韵股份	18,699,140.00	3.65
73	300623	捷捷微电	18,466,497.26	3.61
74	600196	复星医药	17,711,101.80	3.46
75	002036	联创电子	17,639,116.30	3.44
76	601328	交通银行	17,540,000.00	3.43
77	601601	中国太保	17,512,988.64	3.42
78	000672	上峰水泥	17,483,366.00	3.41
79	600583	海油工程	17,311,829.30	3.38
80	002410	广联达	17,293,138.04	3.38
81	600588	用友网络	17,149,018.50	3.35
82	300166	东方国信	17,096,845.91	3.34
83	600598	北大荒	16,986,769.56	3.32
84	601288	农业银行	16,695,000.00	3.26
85	603929	亚翔集成	16,512,369.00	3.22
86	300408	三环集团	16,392,691.00	3.20
87	300203	聚光科技	16,027,617.74	3.13
88	002675	东诚药业	15,972,903.28	3.12
89	600690	青岛海尔	15,894,932.92	3.10
90	002372	伟星新材	15,568,761.68	3.04
91	601800	中国交建	15,501,634.56	3.03
92	300687	赛意信息	15,287,050.40	2.99
93	300059	东方财富	15,195,734.46	2.97
94	600340	华夏幸福	15,111,069.12	2.95
95	300122	智飞生物	15,056,525.00	2.94
96	000998	隆平高科	14,976,706.32	2.92
97	600990	四创电子	14,928,117.37	2.92
98	300609	汇纳科技	14,593,909.00	2.85
99	002456	欧菲科技	14,402,774.22	2.81
100	000786	北新建材	14,325,255.86	2.80
101	601011	宝泰隆	14,320,975.00	2.80

102	002065	东华软件	13,911,191.97	2.72
103	002544	杰赛科技	13,870,954.99	2.71
104	600073	上海梅林	13,861,871.71	2.71
105	603383	顶点软件	13,731,034.00	2.68
106	300747	锐科激光	13,698,911.84	2.68
107	600503	华丽家族	13,480,616.00	2.63
108	300624	万兴科技	13,467,909.91	2.63
109	300659	中孚信息	13,383,509.88	2.61
110	600036	招商银行	13,370,074.36	2.61
111	000547	航天发展	13,357,588.56	2.61
112	000606	顺利办	13,325,995.41	2.60
113	300347	泰格医药	13,275,935.00	2.59
114	300348	长亮科技	13,252,875.86	2.59
115	002157	正邦科技	13,223,262.29	2.58
116	600360	华微电子	12,958,585.22	2.53
117	002321	华英农业	12,926,600.77	2.52
118	300431	暴风集团	12,845,234.62	2.51
119	002202	金风科技	12,795,152.40	2.50
120	600884	杉杉股份	12,760,338.47	2.49
121	000089	深圳机场	12,720,882.22	2.48
122	300699	光威复材	12,692,850.71	2.48
123	600845	宝信软件	12,689,414.26	2.48
124	603002	宏昌电子	12,584,898.50	2.46
125	002698	博实股份	12,577,038.67	2.46
126	600887	伊利股份	12,372,199.80	2.42
127	603297	永新光学	12,282,209.80	2.40
128	600438	通威股份	12,246,179.76	2.39
129	601766	中国中车	12,143,595.00	2.37
130	603345	安井食品	12,011,144.60	2.35
131	300454	深信服	11,788,149.19	2.30
132	002659	凯文教育	11,704,991.35	2.29
133	601818	光大银行	11,475,004.00	2.24
134	002171	楚江新材	11,405,468.94	2.23
135	600495	晋西车轴	11,355,977.00	2.22
136	300468	四方精创	11,329,518.00	2.21
137	601669	中国电建	11,199,437.79	2.19
138	300740	御家汇	11,162,851.00	2.18
139	002007	华兰生物	11,054,647.10	2.16
140	300311	任子行	10,934,979.50	2.14
141	600188	兖州煤业	10,848,296.66	2.12
142	002341	新纶科技	10,738,343.00	2.10
143	603659	璞泰来	10,728,807.00	2.10
144	601998	中信银行	10,689,196.73	2.09
145	002224	三力士	10,614,734.00	2.07

146	601333	广深铁路	10,542,784.00	2.06
147	300496	中科创达	10,518,999.33	2.05
148	002268	卫 士 通	10,468,634.00	2.04
149	300287	飞利信	10,301,063.00	2.01

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

8.4.3 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	5,108,210,676.15
卖出股票的收入（成交）总额	5,182,235,352.98

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	65,376,000.00	10.33
	其中：政策性金融债	65,376,000.00	10.33
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	65,376,000.00	10.33

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	180205	18 国开 05	600,000	65,376,000.00	10.33

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金无资产支持证券投资。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金无权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	828,664.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,704,148.08
5	应收申购款	25,276,989.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,809,801.92

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息**9.1 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

12,260	21,113.87	115,913,714.68	44.78%	142,942,319.18	55.22%
--------	-----------	----------------	--------	----------------	--------

9.2 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	140,512.98	0.05%

注：本公司所有从业人员持有本基金份额总量为 140512.98 份。

9.3 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	0~10
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、基金投资和部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0~10 万份；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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009 年 7 月 13 日)基金份额总额	3,132,175,900.10
本报告期期初基金份额总额	188,714,948.35
本报告期基金总申购份额	220,548,092.30
减：本报告期基金总赎回份额	150,407,006.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	258,856,033.86

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所情况。报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。审计年限为 1 年。自 2010 年至 2018 年，瑞华会计师事务所为本基金连续提供 9 年审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 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	
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	1,553,122,130.20	15.11%	1,316,219.73	15.64%	-
西南证券	1	1,037,924,179.34	10.10%	759,032.67	9.02%	-
中金证券	1	853,218,921.17	8.30%	623,955.81	7.42%	-
招商证券	1	846,261,472.47	8.24%	788,124.71	9.37%	-
海通证券	1	772,760,679.41	7.52%	719,672.93	8.55%	-
中信证券	3	657,145,773.85	6.39%	585,515.33	6.96%	-
宏源证券	1	431,098,255.94	4.20%	315,262.53	3.75%	-
安信证券	1	379,663,992.16	3.69%	353,581.83	4.20%	-
国泰君安	1	340,048,350.25	3.31%	316,684.04	3.76%	-
广发证券	3	1,219,831,171.02	11.87%	1,000,075.11	11.89%	-
方正证券	1	289,773,284.04	2.82%	211,910.52	2.52%	-
恒泰证券	2	580,013,888.69	5.64%	424,166.16	5.04%	-
华泰证券	1	175,981,921.49	1.71%	128,696.08	1.53%	-
国信证券	1	139,810,618.90	1.36%	130,206.69	1.55%	-
天风证券	2	820,133,856.07	7.98%	599,766.30	7.13%	-
中信建投证券	2	58,815,869.99	0.57%	43,012.56	0.51%	-

新时代证券	1	50,531,252.91	0.49%	47,060.12	0.56%	-
东北证券	2	69,919,775.26	0.68%	51,132.13	0.61%	-

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 31 个交易席位，其中报告期内新增 4 个交易席位，退租 1 个交易席位。新增交易席位为：中信证券上海和深圳交易席位、中信建投证券上海和深圳交易席位；退租新时代证券沪市席位。

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。

11.7.2 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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		证成交总 额的比例
长江证券	-	-	350,000,000.00	15.91%	-	-
西南证券	-	-	190,000,000.00	8.64%	-	-
中金证券	-	-	100,000,000.00	4.55%	-	-
海通证券	-	-	190,000,000.00	8.64%	-	-
中信证券	-	-	500,000,000.00	22.73%	-	-
国泰君安	-	-	40,000,000.00	1.82%	-	-
广发证券	-	-	160,000,000.00	7.27%	-	-
恒泰证券	-	-	100,000,000.00	4.55%	-	-
国信证券	-	-	100,000,000.00	4.55%	-	-
天风证券	-	-	100,000,000.00	4.55%	-	-
中信建投证券	-	-	150,000,000.00	6.82%	-	-
新时代证券	-	-	170,000,000.00	7.73%	-	-
东北证券	-	-	50,000,000.00	2.27%	-	-

注：回购交易不包含非担保交收金额。

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

新华基金管理股份有限公司

二〇一九年三月二十八日