

**新华中小市值优选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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	新华中小市值优选混合
基金主代码	519097
交易代码	519097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 28 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,521,401.60 份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资，力求实现基金净值增长率持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金以合理价格成长选股策略（GARP）为核心，精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证 700 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	田青
	联系电话	010-68779688	010-67595096
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008198866	010-67595096

传真	010-68779528	010-66275865
----	--------------	--------------

## 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	-17,577,174.57	-3,386,056.58	-63,400,533.55
本期利润	-18,279,756.47	-2,531,132.48	-67,055,119.86
加权平均基金份额本期利润	-0.3924	-0.0301	-0.2735
本期基金份额净值增长率	-26.82%	-1.08%	-10.79%
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	0.0784	0.4715	0.5035
期末基金资产净值	52,042,618.53	116,683,192.29	175,752,610.81
期末基金份额净值	1.143	1.562	1.579

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	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-8.41%	1.76%	-9.88%	1.45%	1.47%	0.31%
过去六个月	-14.45%	1.68%	-15.63%	1.27%	1.18%	0.41%
过去一年	-26.82%	1.64%	-25.96%	1.17%	-0.86%	0.47%
过去三年	-35.42%	1.47%	-33.92%	1.14%	-1.50%	0.33%
过去五年	57.31%	1.62%	11.03%	1.40%	46.28%	0.22%
自基金合同生效起至今	63.29%	1.45%	-3.76%	1.32%	67.05%	0.13%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中证 700 指数收益率，债券投资部分的业绩比较基准选择上证国债指数收益率，复合业绩比较基准为 80%×中证 700 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。

### 3.2.2 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

新华中小市值优选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  
 (2011 年 1 月 28 日至 2018 年 12 月 31 日)



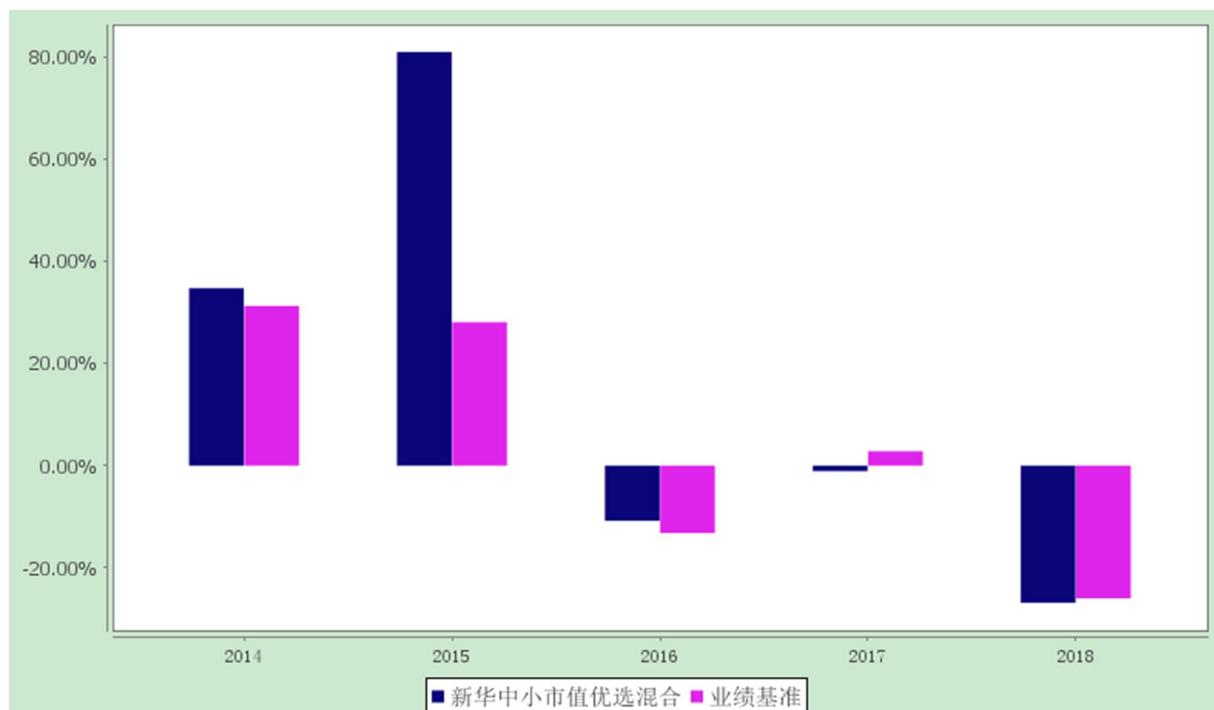
注：本基金于 2011 年 1 月 28 日基金合同生效。

报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

### 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

新华中小市值优选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		
付伟	本基金基金经理，新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理、新华外延增长主题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、新华战略新兴产业灵活配置混合	2016-06-17	-	8	西安交通大学工学硕士，北京大学工商管理硕士,历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理，新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与 TMT 组组长，先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。

	型证券投资基金基金经理。				
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、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2017-07-18	2018-08-27	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。

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中小市值优选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》、《新华中小市值优选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 A 股市场呈现震荡向下的走势，以接近最低点收盘。上证综指下跌 24.59%，创业板指下跌 28.65%，均创近年来最大跌幅。本基金根据基金合同约定，精选各个行业中具有较高成长性且估值合理的中小市值股票进行投资，追求获取长期超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.143 元，本报告期份额净值增长率为-26.82%，同期比较基准的增长率为-25.96%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济处于寻底阶段，政府认识清醒，不走老路，未来重点在于进一步扩大改革开放，发展战略新兴产业，着力解决制约经济发展的瓶颈问题。市场整体估值水平仍处于较低位置，预计将走出震荡向上的态势。

本基金将保持中性至偏高仓位，注意把握其中的结构性机会，一方面，行业景气度处于底部拐

点向上，或者即将出现拐点的行业，如畜禽养殖、5G、文化娱乐等行业；另一方面，符合经济结构转型升级、面向未来的战略新兴产业，如芯片、国产软件、生物医药、先进制造等行业。个股选择上，重点布局调整充分，业绩稳健，估值处于较低水平，成长性良好的个股。

#### 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是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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基

金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## §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】01360018 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：新华中小市值优选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	21,014,889.11	34,792,246.63
结算备付金	867,906.80	1,077,891.75
存出保证金	97,873.23	126,004.48
交易性金融资产	44,091,684.76	71,640,555.94
其中：股票投资	44,091,684.76	71,640,555.94
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	10,000,000.00
应收证券清算款	-	512,566.92
应收利息	4,188.85	25,488.48
应收股利	-	-
应收申购款	9,769.67	26,185.50
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>66,086,312.42</b>	<b>118,200,939.70</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
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	12,989,511.56	125,216.66
应付赎回款	52,018.90	49,101.52
应付管理人报酬	69,463.61	148,476.83
应付托管费	11,577.27	24,746.11
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	540,983.58	790,069.87
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	380,138.97	380,136.42
<b>负债合计</b>	<b>14,043,693.89</b>	<b>1,517,747.41</b>

所有者权益：	-	-
实收基金	45,521,401.60	74,707,001.27
未分配利润	6,521,216.93	41,976,191.02
<b>所有者权益合计</b>	<b>52,042,618.53</b>	<b>116,683,192.29</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>66,086,312.42</b>	<b>118,200,939.70</b>

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.143 元。基金份额总额 45,521,401.60 份。

## 7.2 利润表

会计主体：新华中小市值优选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	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
<b>一、收入</b>	<b>-13,552,613.86</b>	<b>3,298,816.71</b>
1.利息收入	93,831.70	265,369.76
其中：存款利息收入	85,105.66	176,379.37
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	8,726.04	88,990.39
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-12,973,852.73	2,117,327.00
其中：股票投资收益	-13,295,546.42	1,677,905.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	321,693.69	439,421.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填	-702,581.90	854,924.10

列)		
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	29,989.07	61,195.85
<b>减: 二、费用</b>	<b>4,727,142.61</b>	<b>5,829,949.19</b>
1. 管理人报酬	956,972.43	1,915,409.21
2. 托管费	159,495.38	319,234.75
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,224,345.30	3,206,228.68
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	386,329.50	389,076.55
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>-18,279,756.47</b>	<b>-2,531,132.48</b>
减: 所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>-18,279,756.47</b>	<b>-2,531,132.48</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 新华中小市值优选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)	74,707,001.27	41,976,191.02	116,683,192.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-18,279,756.47	-18,279,756.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-29,185,599.67	-17,175,217.62	-46,360,817.29

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	12,410,695.31	3,982,566.47	16,393,261.78
2.基金赎回款	-41,596,294.98	-21,157,784.09	-62,754,079.07
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）	45,521,401.60	6,521,216.93	52,042,618.53
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）	111,310,515.63	64,442,095.18	175,752,610.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,531,132.48	-2,531,132.48
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）	-36,603,514.36	-19,934,771.68	-56,538,286.04
其中：1.基金申购款	13,247,734.77	6,670,118.11	19,917,852.88
2.基金赎回款	-49,851,249.13	-26,604,889.79	-76,456,138.92
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）	74,707,001.27	41,976,191.02	116,683,192.29

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

新华中小市值优选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[2010]1403 号文件“关于核准新华中小市值优选混合型证券投资基金募集的批复”，由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于 2011 年 1 月 4 日至 1 月 25 日向社会公开募集，首次募集资金总额 742,965,884.43 元，其中募集净认购资金金额 742,773,420.20 元，募集资金产生利息 192,464.23 元，并经国富浩华会计师事务所（特殊普通合伙）浩华验字[2011]第 1 号验资报告予以验证。2011 年 1 月 28 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书》及《新华中小市值优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中中小市值股票投资占基金股票资产的比例不低于 80%，债券投资占基金资产的比例范围为 0%-40%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0%-20%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0%-3%，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%。本基金的业绩比较基准为：80%\*中证 700 指数收益率+20%\*上证国债指数收益率。

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》、《新华中小市值优选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

本基金报告期内未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

### 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、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
中国建设银行股份有限公司	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
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
恒泰证券股份有限公司	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
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东
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
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

#### 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	600,706,643.47	25.28%	273,451,171.82	11.85%

## 7.4.8.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间,本基金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

本报告期及上年度可比期间,本基金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

本报告期及上年度可比期间,本基金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	439,297.04	24.16%	89,055.40	16.46%
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	199,975.36	11.08%	97,927.04	12.39%

司				
---	--	--	--	--

#### 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	956,972.43	1,915,409.21
其中：支付销售机构的客户维护费	464,461.74	639,067.71

注：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。

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托管费	159,495.38	319,234.75

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未进行银行间同业市场的债券(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

本报告期及上年度可比期间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**

本报告期末及上年度末，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
中国建设银行	21,014,889.11	66,180.69	34,792,246.63	158,040.15

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**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 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.9.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.2.1 银行间市场债券正回购**

本基金报告期末未有银行间市场债券正回购。

**7.4.9.2.2 交易所市场债券正回购**

本基金报告期末未有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	44,091,684.76	66.72
	其中：股票	44,091,684.76	66.72
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	21,882,795.91	33.11
7	其他各项资产	111,831.75	0.17
8	合计	66,086,312.42	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	2,806,218.08	5.39
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,906,230.40	44.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	695,000.00	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,346,900.00	10.27
J	金融业	1,545,000.00	2.97
K	房地产业	795,000.00	1.53
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,710,000.00	3.29
R	文化、体育和娱乐业	8,287,336.28	15.92
S	综合	-	-
	合计	44,091,684.76	84.72

### 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	300347	泰格医药	40,000	1,710,000.00	3.29
2	000802	北京文化	150,000	1,660,500.00	3.19
3	002299	圣农发展	100,002	1,654,033.08	3.18
4	002157	正邦科技	300,000	1,593,000.00	3.06
5	000977	浪潮信息	100,000	1,592,000.00	3.06
6	600373	中文传媒	120,000	1,561,200.00	3.00
7	000783	长江证券	300,000	1,545,000.00	2.97
8	002174	游族网络	80,000	1,487,200.00	2.86
9	300413	芒果超媒	40,028	1,481,436.28	2.85
10	000876	新希望	200,000	1,456,000.00	2.80

## 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	000002	万 科 A	18,022,037.93	15.45
2	600030	中信证券	16,891,396.00	14.48
3	601555	东吴证券	15,943,419.09	13.66
4	600570	恒生电子	14,927,655.53	12.79
5	603019	中科曙光	14,666,041.00	12.57
6	600036	招商银行	14,559,626.14	12.48
7	601688	华泰证券	13,117,991.55	11.24
8	002146	荣盛发展	11,784,572.00	10.10
9	002343	慈文传媒	11,725,146.80	10.05
10	001979	招商蛇口	10,648,857.60	9.13
11	600879	航天电子	10,542,470.36	9.04
12	600038	中直股份	10,501,497.75	9.00
13	300059	东方财富	9,973,886.60	8.55
14	002905	金逸影视	9,153,887.88	7.85
15	300253	卫宁健康	8,861,007.43	7.59
16	000977	浪潮信息	8,799,254.00	7.54
17	300251	光线传媒	8,250,192.60	7.07
18	600967	内蒙一机	8,144,134.92	6.98
19	300655	晶瑞股份	8,144,046.30	6.98
20	300027	华谊兄弟	8,006,497.00	6.86
21	603103	横店影视	7,668,746.00	6.57
22	002268	卫 士 通	7,652,837.80	6.56
23	000858	五 粮 液	7,637,012.00	6.55
24	002371	北方华创	7,568,509.00	6.49
25	600600	青岛啤酒	7,420,130.66	6.36
26	600136	当代明诚	7,363,179.00	6.31
27	000783	长江证券	7,316,995.00	6.27
28	603929	亚翔集成	7,270,815.00	6.23
29	601788	光大证券	7,188,419.00	6.16
30	603323	吴江银行	6,689,482.00	5.73
31	603369	今世缘	6,683,986.30	5.73
32	600887	伊利股份	6,662,299.98	5.71
33	600845	宝信软件	6,654,607.05	5.70
34	000802	北京文化	6,605,422.33	5.66
35	600702	舍得酒业	6,535,471.00	5.60

36	300426	唐德影视	6,405,515.00	5.49
37	600893	航发动力	6,405,432.28	5.49
38	300558	贝达药业	6,382,152.00	5.47
39	000800	一汽轿车	6,176,212.00	5.29
40	000333	美的集团	6,109,419.00	5.24
41	603160	汇顶科技	6,105,085.00	5.23
42	002281	光迅科技	5,964,706.00	5.11
43	601599	鹿港文化	5,950,718.38	5.10
44	000001	平安银行	5,922,936.00	5.08
45	600667	太极实业	5,907,319.00	5.06
46	000513	丽珠集团	5,754,118.72	4.93
47	002405	四维图新	5,716,055.00	4.90
48	000651	格力电器	5,684,140.21	4.87
49	000671	阳光城	5,681,101.00	4.87
50	000729	燕京啤酒	5,667,253.00	4.86
51	002153	石基信息	5,597,605.00	4.80
52	600584	长电科技	5,597,037.00	4.80
53	300070	碧水源	5,466,118.00	4.68
54	000892	欢瑞世纪	5,419,884.33	4.64
55	000063	中兴通讯	5,392,919.00	4.62
56	600760	中航沈飞	5,378,661.00	4.61
57	600332	白云山	5,372,108.00	4.60
58	600977	中国电影	5,284,778.43	4.53
59	300369	绿盟科技	5,280,230.52	4.53
60	002384	东山精密	5,095,035.00	4.37
61	300474	景嘉微	5,091,781.00	4.36
62	002174	游族网络	5,054,566.62	4.33
63	600048	保利地产	5,053,207.00	4.33
64	601949	中国出版	4,982,903.27	4.27
65	601225	陕西煤业	4,911,957.00	4.21
66	600519	贵州茅台	4,892,605.59	4.19
67	300496	中科创达	4,887,292.72	4.19
68	002007	华兰生物	4,765,173.20	4.08
69	300413	芒果超媒	4,731,449.80	4.05
70	600229	城市传媒	4,592,364.00	3.94
71	300170	汉得信息	4,575,705.00	3.92
72	600801	华新水泥	4,464,026.62	3.83
73	601952	苏垦农发	4,444,944.00	3.81
74	600585	海螺水泥	4,425,781.00	3.79
75	600416	湘电股份	4,343,429.00	3.72
76	600019	宝钢股份	4,297,289.00	3.68
77	002230	科大讯飞	4,269,195.00	3.66
78	300347	泰格医药	4,209,400.34	3.61
79	300348	长亮科技	4,178,284.96	3.58

80	600867	通化东宝	4,150,023.14	3.56
81	600958	东方证券	4,142,904.87	3.55
82	600743	华远地产	4,002,437.00	3.43
83	000860	顺鑫农业	3,990,981.00	3.42
84	300166	东方国信	3,947,563.00	3.38
85	600729	重庆百货	3,934,242.00	3.37
86	000938	紫光股份	3,925,537.00	3.36
87	300024	机器人	3,906,667.00	3.35
88	601398	工商银行	3,906,500.00	3.35
89	000776	广发证券	3,825,178.00	3.28
90	300003	乐普医疗	3,810,049.00	3.27
91	300271	华宇软件	3,802,560.98	3.26
92	600523	贵航股份	3,794,725.60	3.25
93	300659	中孚信息	3,762,732.00	3.22
94	000961	中南建设	3,743,654.15	3.21
95	002792	通宇通讯	3,737,041.00	3.20
96	603589	口子窖	3,735,352.00	3.20
97	600050	中国联通	3,707,000.00	3.18
98	600562	国睿科技	3,705,527.56	3.18
99	300315	掌趣科技	3,700,100.00	3.17
100	300188	美亚柏科	3,652,651.00	3.13
101	002661	克明面业	3,548,276.00	3.04
102	002229	鸿博股份	3,485,607.00	2.99
103	603078	江化微	3,456,544.40	2.96
104	601336	新华保险	3,445,440.00	2.95
105	002029	七匹狼	3,440,811.68	2.95
106	601328	交通银行	3,365,106.71	2.88
107	603900	莱绅通灵	3,357,769.80	2.88
108	603636	南威软件	3,348,254.50	2.87
109	000895	双汇发展	3,345,184.00	2.87
110	600536	中国软件	3,343,159.00	2.87
111	600028	中国石化	3,265,300.00	2.80
112	600588	用友网络	3,262,481.00	2.80
113	600029	南方航空	3,247,716.00	2.78
114	600373	中文传媒	3,216,809.97	2.76
115	600188	兖州煤业	3,207,383.00	2.75
116	600703	三安光电	3,195,573.00	2.74
117	000768	中航飞机	3,173,985.00	2.72
118	601009	南京银行	3,129,000.00	2.68
119	600132	重庆啤酒	3,122,045.94	2.68
120	603393	新天然气	3,087,974.00	2.65
121	603365	水星家纺	3,084,574.00	2.64
122	600482	中国动力	3,083,732.00	2.64
123	600855	航天长峰	3,068,642.00	2.63

124	601601	中国太保	3,056,618.20	2.62
125	300133	华策影视	3,054,971.00	2.62
126	300528	幸福蓝海	3,052,792.20	2.62
127	000927	一汽夏利	3,016,062.00	2.58
128	300452	山河药辅	3,007,150.00	2.58
129	002368	太极股份	3,002,186.28	2.57
130	002751	易尚展示	2,956,314.00	2.53
131	601668	中国建筑	2,921,731.00	2.50
132	002157	正邦科技	2,865,842.00	2.46
133	002065	东华软件	2,805,389.00	2.40
134	300418	昆仑万维	2,779,232.12	2.38
135	300073	当升科技	2,736,588.00	2.35
136	601899	紫金矿业	2,666,854.00	2.29
137	601988	中国银行	2,658,000.00	2.28
138	002714	牧原股份	2,646,179.83	2.27
139	002796	世嘉科技	2,634,902.00	2.26
140	300081	恒信东方	2,616,827.92	2.24
141	002262	恩华药业	2,612,151.00	2.24
142	002129	中环股份	2,609,498.00	2.24
143	002439	启明星辰	2,593,063.55	2.22
144	600884	杉杉股份	2,591,749.00	2.22
145	600782	新钢股份	2,565,603.00	2.20
146	000661	长春高新	2,550,254.00	2.19
147	300451	创业慧康	2,532,325.00	2.17
148	300571	平治信息	2,470,664.00	2.12
149	601229	上海银行	2,466,247.76	2.11
150	000712	锦龙股份	2,466,036.00	2.11
151	002655	共达电声	2,461,810.52	2.11
152	300291	华录百纳	2,455,744.00	2.10
153	603816	顾家家居	2,441,837.00	2.09
154	002456	欧菲科技	2,412,916.00	2.07
155	300339	润和软件	2,358,915.00	2.02
156	601166	兴业银行	2,356,500.00	2.02
157	603399	吉翔股份	2,342,132.00	2.01
158	300122	智飞生物	2,338,457.00	2.00
159	002475	立讯精密	2,335,231.00	2.00
160	601998	中信银行	2,333,854.00	2.00

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	000002	万 科 A	17,983,177.32	15.41
2	600030	中信证券	17,086,103.00	14.64
3	601555	东吴证券	15,913,036.07	13.64
4	600570	恒生电子	15,211,969.78	13.04
5	600036	招商银行	14,561,249.84	12.48
6	603019	中科曙光	13,480,511.00	11.55
7	000001	平安银行	12,746,739.79	10.92
8	601688	华泰证券	12,673,804.23	10.86
9	001979	招商蛇口	10,853,542.00	9.30
10	600879	航天电子	10,555,699.00	9.05
11	002146	荣盛发展	10,429,889.00	8.94
12	600038	中直股份	10,156,702.19	8.70
13	300655	晶瑞股份	9,946,605.81	8.52
14	002343	慈文传媒	9,810,541.00	8.41
15	300059	东方财富	9,807,680.00	8.41
16	300253	卫宁健康	9,202,651.98	7.89
17	002905	金逸影视	9,018,747.70	7.73
18	300251	光线传媒	8,282,654.00	7.10
19	600967	内蒙一机	8,112,727.86	6.95
20	600600	青岛啤酒	7,895,313.40	6.77
21	002268	卫 士 通	7,723,799.28	6.62
22	300027	华谊兄弟	7,717,062.91	6.61
23	000858	五 粮 液	7,467,670.98	6.40
24	000977	浪潮信息	7,431,444.20	6.37
25	601788	光大证券	7,343,346.51	6.29
26	603103	横店影视	7,178,299.00	6.15
27	603929	亚翔集成	6,850,923.78	5.87
28	600136	当代明诚	6,839,111.88	5.86
29	603369	今世缘	6,787,501.02	5.82
30	300567	精测电子	6,628,460.00	5.68
31	600893	航发动力	6,568,814.61	5.63
32	600845	宝信软件	6,494,073.00	5.57
33	603323	吴江银行	6,487,357.00	5.56
34	300426	唐德影视	6,386,811.00	5.47
35	600887	伊利股份	6,349,213.00	5.44
36	002371	北方华创	6,324,803.25	5.42
37	600702	舍得酒业	6,296,307.66	5.40
38	000333	美的集团	6,052,366.83	5.19
39	600760	中航沈飞	6,036,175.96	5.17
40	600114	东睦股份	5,998,598.00	5.14
41	000783	长江证券	5,859,418.62	5.02

42	000800	一汽轿车	5,852,037.00	5.02
43	300558	贝达药业	5,759,814.00	4.94
44	000802	北京文化	5,750,595.00	4.93
45	002281	光迅科技	5,727,565.00	4.91
46	000429	粤高速 A	5,692,700.00	4.88
47	000651	格力电器	5,688,737.16	4.88
48	603160	汇顶科技	5,632,777.00	4.83
49	000513	丽珠集团	5,601,361.00	4.80
50	000671	阳光城	5,595,582.00	4.80
51	600667	太极实业	5,508,274.00	4.72
52	600033	福建高速	5,477,000.00	4.69
53	600584	长电科技	5,444,559.95	4.67
54	000729	燕京啤酒	5,407,542.00	4.63
55	603197	保隆科技	5,367,529.58	4.60
56	300070	碧水源	5,358,699.00	4.59
57	002153	石基信息	5,344,711.00	4.58
58	300496	中科创达	5,220,729.00	4.47
59	300369	绿盟科技	5,193,464.04	4.45
60	600048	保利地产	5,186,759.00	4.45
61	601599	鹿港文化	5,184,429.45	4.44
62	002007	华兰生物	5,176,266.70	4.44
63	002405	四维图新	5,145,085.00	4.41
64	000063	中兴通讯	5,078,083.00	4.35
65	600519	贵州茅台	4,933,087.56	4.23
66	601225	陕西煤业	4,625,023.00	3.96
67	002384	东山精密	4,514,880.34	3.87
68	600229	城市传媒	4,501,970.44	3.86
69	600585	海螺水泥	4,370,583.00	3.75
70	600332	白云山	4,363,248.00	3.74
71	300170	汉得信息	4,343,477.62	3.72
72	600416	湘电股份	4,319,904.55	3.70
73	002230	科大讯飞	4,300,106.28	3.69
74	000888	峨眉山 A	4,294,586.80	3.68
75	600867	通化东宝	4,248,952.52	3.64
76	000892	欢瑞世纪	4,206,744.20	3.61
77	600801	华新水泥	4,195,378.00	3.60
78	300315	掌趣科技	4,128,028.00	3.54
79	600958	东方证券	4,122,627.00	3.53
80	600019	宝钢股份	4,118,685.99	3.53
81	600743	华远地产	4,100,770.00	3.51
82	002368	太极股份	4,048,983.71	3.47
83	300348	长亮科技	4,045,851.00	3.47
84	300166	东方国信	4,028,865.00	3.45
85	000860	顺鑫农业	3,973,546.00	3.41

86	300413	芒果超媒	3,915,519.00	3.36
87	300271	华宇软件	3,876,856.50	3.32
88	600977	中国电影	3,867,407.60	3.31
89	600050	中国联通	3,855,500.00	3.30
90	600523	贵航股份	3,853,422.00	3.30
91	300024	机器人	3,849,315.24	3.30
92	600729	重庆百货	3,822,521.00	3.28
93	601398	工商银行	3,794,000.00	3.25
94	300188	美亚柏科	3,793,360.00	3.25
95	000776	广发证券	3,750,496.00	3.21
96	000938	紫光股份	3,714,824.00	3.18
97	002229	鸿博股份	3,673,958.00	3.15
98	300474	景嘉微	3,638,983.00	3.12
99	603900	莱绅通灵	3,638,030.00	3.12
100	000932	华菱钢铁	3,603,473.96	3.09
101	000961	中南建设	3,590,003.00	3.08
102	601949	中国出版	3,575,906.00	3.06
103	600028	中国石化	3,551,143.00	3.04
104	600132	重庆啤酒	3,502,077.00	3.00
105	000895	双汇发展	3,474,611.00	2.98
106	601336	新华保险	3,465,619.98	2.97
107	002398	建研集团	3,432,500.00	2.94
108	300394	天孚通信	3,423,933.00	2.93
109	600562	国睿科技	3,411,399.12	2.92
110	002029	七匹狼	3,409,717.16	2.92
111	002174	游族网络	3,388,876.92	2.90
112	600285	羚锐制药	3,352,264.00	2.87
113	600536	中国软件	3,345,142.00	2.87
114	601328	交通银行	3,344,000.00	2.87
115	000768	中航飞机	3,330,274.34	2.85
116	603078	江化微	3,302,268.40	2.83
117	300447	全信股份	3,257,252.00	2.79
118	603002	宏昌电子	3,256,919.50	2.79
119	600029	南方航空	3,208,619.00	2.75
120	601601	中国太保	3,097,174.28	2.65
121	300133	华策影视	3,095,995.19	2.65
122	601668	中国建筑	3,078,000.00	2.64
123	600188	兖州煤业	3,071,098.60	2.63
124	600855	航天长峰	3,068,912.00	2.63
125	601009	南京银行	3,062,061.00	2.62
126	600482	中国动力	3,060,666.00	2.62
127	600703	三安光电	3,054,428.00	2.62
128	603393	新天然气	3,052,033.10	2.62
129	601952	苏垦农发	3,042,435.50	2.61

130	600718	东软集团	2,964,725.00	2.54
131	603365	水星家纺	2,953,902.89	2.53
132	300528	幸福蓝海	2,892,882.00	2.48
133	000927	一汽夏利	2,866,400.00	2.46
134	002751	易尚展示	2,823,933.00	2.42
135	002792	通宇通讯	2,778,587.85	2.38
136	000652	泰达股份	2,729,980.00	2.34
137	601988	中国银行	2,688,000.00	2.30
138	002696	百洋股份	2,661,774.00	2.28
139	300452	山河药辅	2,658,502.00	2.28
140	603589	口子窖	2,642,690.65	2.26
141	600884	杉杉股份	2,635,211.00	2.26
142	002065	东华软件	2,625,128.00	2.25
143	600782	新钢股份	2,616,371.84	2.24
144	601899	紫金矿业	2,584,700.00	2.22
145	300081	恒信东方	2,568,179.20	2.20
146	000661	长春高新	2,545,895.80	2.18
147	300073	当升科技	2,540,752.00	2.18
148	300418	昆仑万维	2,515,388.00	2.16
149	300451	创业慧康	2,504,963.00	2.15
150	601998	中信银行	2,484,000.00	2.13
151	603636	南威软件	2,477,925.00	2.12
152	601229	上海银行	2,464,103.62	2.11
153	002456	欧菲科技	2,426,082.82	2.08
154	300122	智飞生物	2,417,882.00	2.07
155	300571	平治信息	2,413,340.00	2.07
156	002262	恩华药业	2,403,736.00	2.06
157	601818	光大银行	2,400,000.00	2.06
158	603816	顾家家居	2,381,692.00	2.04
159	300604	长川科技	2,380,800.00	2.04
160	603399	吉翔股份	2,378,571.00	2.04
161	300003	乐普医疗	2,376,651.28	2.04
162	002439	启明星辰	2,367,771.35	2.03
163	601166	兴业银行	2,361,979.00	2.02
164	000712	锦龙股份	2,352,385.18	2.02
165	600085	同仁堂	2,335,601.72	2.00

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	1,181,504,093.35
---------------	------------------

卖出股票的收入（成交）总额	1,195,054,836.21
---------------	------------------

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末无权证投资。

#### 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

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

#### 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

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

##### 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 本基金投资前十名股票不存在被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	97,873.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,188.85
5	应收申购款	9,769.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,831.75

**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**

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

**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
3,966	11,477.91	0.00	0.00%	45,521,401.60	100.00%

### 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	0.00	0.00%

注：本公司所有从业人员持有本基金份额总量为 0 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
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。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年1月28日)基金份额总额	742,965,884.43
本报告期期初基金份额总额	74,707,001.27
本报告期基金总申购份额	12,410,695.31
减：本报告期基金总赎回份额	41,596,294.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,521,401.60

## §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 2011 年至 2018 年，瑞华会计师事务所为本基金连续提供 8 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

本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

### 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	
恒泰证券	2	600,706,643.47	25.28%	439,297.04	24.16%	-
华创证券	1	402,110,817.03	16.92%	294,064.32	16.17%	-
广发证券	1	380,288,358.74	16.00%	278,105.05	15.29%	-
安信证券	1	191,345,510.19	8.05%	139,931.40	7.69%	-
太平洋证券	2	174,247,182.21	7.33%	127,426.16	7.01%	-
渤海证券	1	128,617,605.42	5.41%	119,781.52	6.59%	-
国信证券	1	111,394,788.70	4.69%	103,741.62	5.70%	-
中信建投证券	1	100,438,519.43	4.23%	73,450.30	4.04%	-
东北证券	1	82,062,475.40	3.45%	60,011.91	3.30%	-
国金证券	1	79,448,051.84	3.34%	73,989.68	4.07%	-
申银万国	1	63,726,975.64	2.68%	59,348.72	3.26%	-
方正证券	1	41,959,073.18	1.77%	30,684.56	1.69%	-

银河证券	1	20,016,815.03	0.84%	18,641.67	1.03%	-
------	---	---------------	-------	-----------	-------	---

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 15 个交易席位，其中报告期内新增 0 个交易席位，退租 1 个交易席位。退租交易席位为：新时代证券上海交易单元。

#### 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

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 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	20180102-20180104	25,251,839.64	0.00	25,251,839.64	0.00	0.00%
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>							

### 12.2 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