

新华优选成长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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	新华优选成长混合
基金主代码	519089
交易代码	519089
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2008 年 7 月 25 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	1,018,384,563.50 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，优选具有成长性兼具品质保障的上市公司为主要投资对象，力争持续地超越业绩比较基准，为投资者实现超额收益。
投资策略	本基金是混合型基金，选择具有成长性兼具品质保障的股票，因此主要采取自下而上的主动投资管理策略。当然仅应用自下而上的策略可能导致某行业股票集中度过高，行业配置不够分散，造成组合非系统风险高。再考虑到国内系统风险高，因此有必要辅助以适当的资产配置和行业配置策略进行调整。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金资产整体的预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	贺倩
	联系电话	010-68779688	010-66060069

	电子邮箱	qiyang@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816

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	-74,511,396.94	-21,477,091.15	-47,841,086.52
本期利润	-76,051,768.00	-20,932,313.72	-108,906,288.89
加权平均基金份额本期利润	-0.1581	-0.0778	-0.3748
本期基金份额净值增长率	-6.89%	-6.03%	-22.04%
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	-0.0047	0.3069	0.3907
期末基金资产净值	1,013,591,090.32	327,078,245.07	389,946,901.03
期末基金份额净值	0.9953	1.3069	1.3907

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②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.06%	1.22%	-9.65%	1.31%	3.59%	-0.09%
过去六个月	-5.36%	1.13%	-10.90%	1.20%	5.54%	-0.07%
过去一年	-6.89%	1.16%	-19.66%	1.07%	12.77%	0.09%
过去三年	-31.79%	1.56%	-13.44%	0.95%	-18.35%	0.61%
过去五年	9.95%	1.88%	30.72%	1.23%	-20.77%	0.65%
自基金合同生效起至今	156.55%	1.65%	15.63%	1.31%	140.92%	0.34%

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 80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数。

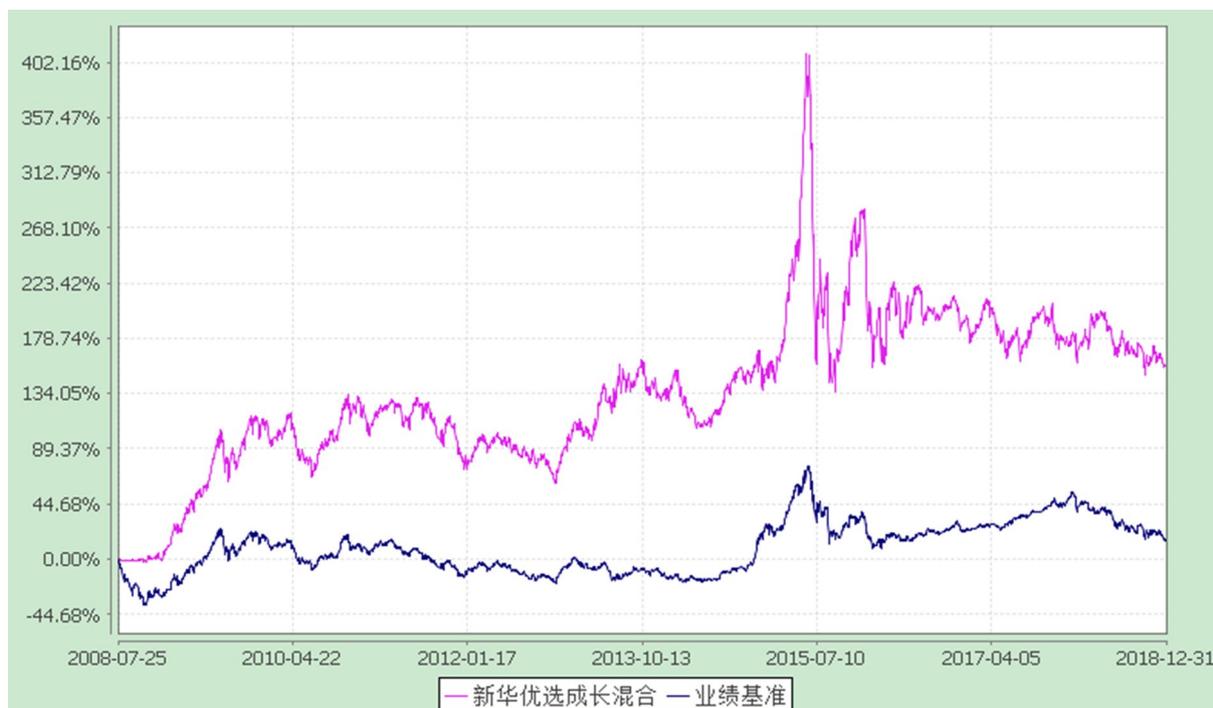
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华优选成长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

(2008 年 7 月 25 日至 2018 年 12 月 31 日)

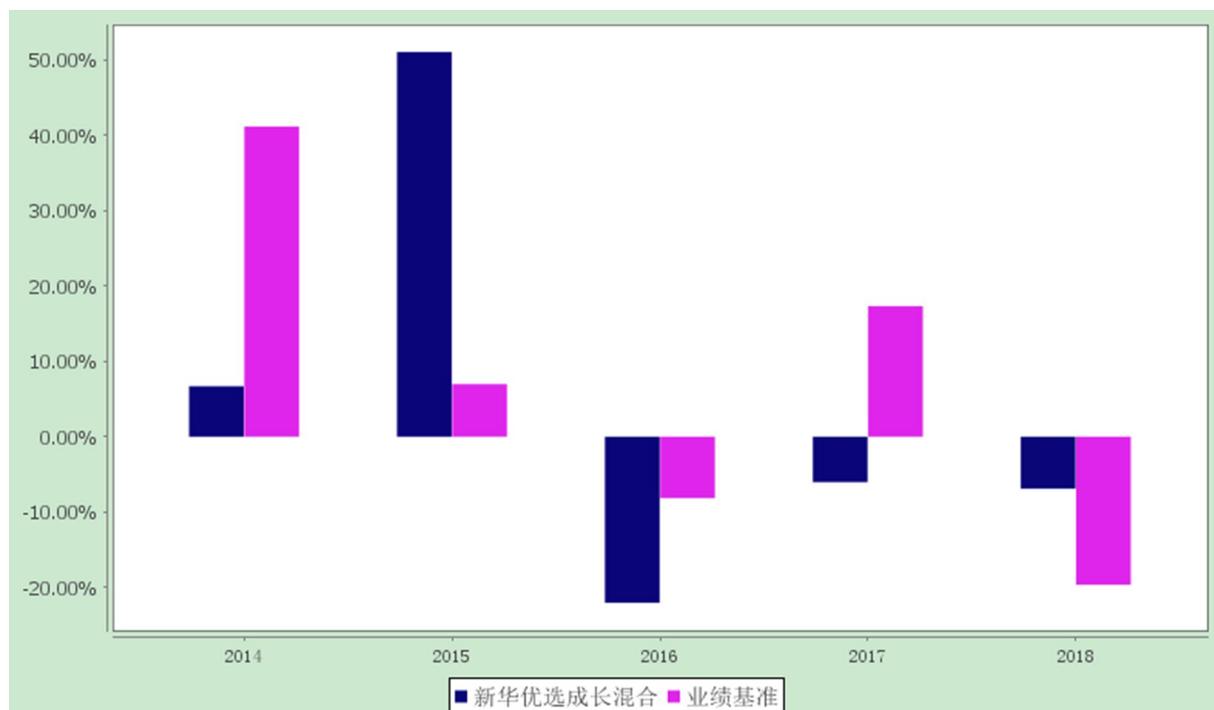


注：本基金于 2008 年 7 月 25 日基金合同生效。

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

新华优选成长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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	2.330	89,607,662.01	62,500,033.75	152,107,695.76	-
合计	2.330	89,607,662.01	62,500,033.75	152,107,695.76	-

§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、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2018-01-05	-	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。

	理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理。				
付伟	本基金基金经理，新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、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、新华钻石品质企业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型证券投资基金基金经理。	2015-08-25	2018-08-27	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。

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优选成长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》、《新华优选成长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 0.9953 元，本报告期份额净值增长率为-6.89%，同期比较基准的增长率为-19.66%。

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

本报告期本基金分别于 2018 年 6 月 25 日每 10 份分红 0.86 元;2018 年 9 月 26 日每 10 份分红 0.58 元;2018 年 12 月 19 日每 10 份分红 0.89 元,三次利润分配,共派发现金红利 89,607,662.01 元,红利再投 62,500,033.75 元。

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形。

§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

在托管新华优选成长混合型证券投资基金的过程中，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，对新华优选成长混合型证券投资基金管理人——新华基金管理股份有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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新华优选成长混合型证券投资基金的投资运作、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、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新华优选成长混合型证券投资基金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 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】01360010 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：新华优选成长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	264,443,573.30	16,869,962.48
结算备付金	9,666,635.40	3,115,972.16
存出保证金	1,087,004.10	341,000.79
交易性金融资产	647,894,799.05	298,018,468.68
其中：股票投资	626,102,799.05	298,018,468.68
基金投资	-	-
债券投资	21,792,000.00	-
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	59,980,289.97	-
应收证券清算款	-	12,375,021.48
应收利息	960,205.14	5,592.02
应收股利	-	-
应收申购款	96,547,439.97	109,790.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,080,579,946.93	330,835,807.86
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	60,534,283.89	-
应付赎回款	64,847.42	295,346.29
应付管理人报酬	1,162,913.82	420,499.18
应付托管费	193,818.97	70,083.19
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,625,555.83	2,563,988.08
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	407,436.68	407,646.05
负债合计	66,988,856.61	3,757,562.79
所有者权益：	-	-
实收基金	1,018,384,563.50	250,262,325.30
未分配利润	-4,793,473.18	76,815,919.77
所有者权益合计	1,013,591,090.32	327,078,245.07
负债和所有者权益总计	1,080,579,946.93	330,835,807.86

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9953 元，基金份额 1,018,384,563.50 份。

7.2 利润表

会计主体：新华优选成长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
一、收入	-47,630,820.23	-7,955,549.78
1.利息收入	2,115,840.72	196,304.91
其中：存款利息收入	1,184,338.61	196,304.91
债券利息收入	512,065.75	-

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	419,436.36	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-48,293,602.04	-8,740,482.44
其中：股票投资收益	-55,511,655.35	-9,957,637.67
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,650.00	-
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	7,226,703.31	1,217,155.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,540,371.06	544,777.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	87,312.15	43,850.32
减：二、费用	28,420,947.77	12,976,763.94
1. 管理人报酬	8,599,591.56	5,495,237.07
2. 托管费	1,433,265.24	915,872.81
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	17,951,652.47	6,151,263.52
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	436,438.50	414,390.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-76,051,768.00	-20,932,313.72
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-76,051,768.00	-20,932,313.72

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华优选成长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）	250,262,325.30	76,815,919.77	327,078,245.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-76,051,768.00	-76,051,768.00
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）	768,122,238.20	146,550,070.81	914,672,309.01
其中：1.基金申购款	859,788,664.74	164,711,619.17	1,024,500,283.91
2.基金赎回款	-91,666,426.54	-18,161,548.36	-109,827,974.90
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）	-	-152,107,695.76	-152,107,695.76
五、期末所有者权益（基金净值）	1,018,384,563.50	-4,793,473.18	1,013,591,090.32
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）	280,393,402.41	109,553,498.62	389,946,901.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-20,932,313.72	-20,932,313.72

期利润)			
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)	-30,131,077.11	-11,805,265.13	-41,936,342.24
其中：1.基金申购款	36,670,777.56	13,079,958.83	49,750,736.39
2.基金赎回款	-66,801,854.67	-24,885,223.96	-91,687,078.63
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)	250,262,325.30	76,815,919.77	327,078,245.07

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

新华优选成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2008]第 377 号《关于核准新世纪优选成长股票型证券投资基金募集的批复》核准, 由新华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新华优选成长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次募集资金总额 278,183,165.01 元, 募集资金产生利息 150,291.05 元, 业经万隆会计师事务所万会业字【2008】第 2329 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新华优选成长混合型证券投资基金基金合同》于 2008 年 7 月 25 日正式生效。本基金的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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新华优选成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法公开发行上市各类股票、债券、短期金融工具、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组

合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%，其它金融工具的投资比例占基金资产的 5%-40%，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%。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。投资于成长性兼具品质保障的股票市值不低于股票投资的 80%。本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数+20%×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》、《新华优选成长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

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
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
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
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
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

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	1,121,586,222.25	8.58%	286,505,885.45	6.57%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未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未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

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	510,000,000.00	31.10%	-	-

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	914,845.10	8.76%	423,243.96	9.15%
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	234,576.87	6.56%	131,173.93	5.12%

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	8,599,591.56	5,495,237.07
其中：支付销售机构的客户维护费	1,331,340.37	1,671,595.24

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

7.4.8.2.2 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12月31日	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	1,433,265.24	915,872.81

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未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)方交易。

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自有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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
中国农业银行股份有	264,443,573.30	1,082,551.79	16,869,962.48	164,691.37

限公司				
-----	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业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

本基金本报告期及上年度可比期间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
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	网下中签	13.77	10.97	292,944.00	4,033,838.88	3,213,595.68	-
300385	雪浪环境	2017-12-13	2020-12-14	非公开发行	29.60	12.48	63,344.00	1,874,982.40	790,533.12	-
300385	雪浪环境	2017-12-13	2021-12-14	非公开发行	29.60	11.98	63,345.00	1,875,012.00	758,873.10	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌流通受限的股票。

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

截止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	626,102,799.05	57.94
	其中：股票	626,102,799.05	57.94
2	固定收益投资	21,792,000.00	2.02
	其中：债券	21,792,000.00	2.02
	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	59,980,289.97	5.55
	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	274,110,208.70	25.37
7	其他各项资产	98,594,649.21	9.12
8	合计	1,080,579,946.93	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	2,875,000.00	0.28
B	采矿业	30,815,640.80	3.04
C	制造业	122,330,301.51	12.07

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,542,241.55	1.83
E	建筑业	20,036,466.00	1.98
F	批发和零售业	43,648,965.49	4.31
G	交通运输、仓储和邮政业	40,367,269.15	3.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,228,841.35	13.14
J	金融业	148,577,309.92	14.66
K	房地产业	42,646,257.68	4.21
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,949,618.40	1.08
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	12,084,887.20	1.19
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	626,102,799.05	61.77

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有沪港通股票。

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	601939	建设银行	7,500,000	47,775,000.00	4.71
2	601398	工商银行	8,999,935	47,609,656.15	4.70
3	300659	中孚信息	2,229,919	44,130,097.01	4.35
4	002129	中环股份	5,400,000	39,042,000.00	3.85
5	300550	和仁科技	699,988	36,595,372.64	3.61
6	600861	北京城乡	4,599,988	31,969,916.60	3.15
7	601988	中国银行	8,000,000	28,880,000.00	2.85

8	603019	中科曙光	750,000	26,910,000.00	2.65
9	601006	大秦铁路	2,999,825	24,688,559.75	2.44
10	600048	保利地产	2,000,000	23,580,000.00	2.33

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	601939	建设银行	182,809,330.68	55.89
2	603019	中科曙光	130,757,361.58	39.98
3	601398	工商银行	127,287,051.05	38.92
4	600048	保利地产	118,109,277.56	36.11
5	002281	光迅科技	115,689,405.61	35.37
6	000768	中航飞机	104,664,206.47	32.00
7	002129	中环股份	77,255,586.42	23.62
8	300567	精测电子	73,623,416.39	22.51
9	000063	中兴通讯	65,225,091.20	19.94
10	001979	招商蛇口	63,805,539.19	19.51
11	601336	新华保险	61,033,368.56	18.66
12	000932	华菱钢铁	57,512,829.10	17.58
13	601318	中国平安	55,880,361.00	17.08
14	300659	中孚信息	55,051,459.59	16.83
15	600029	南方航空	51,555,578.15	15.76
16	600585	海螺水泥	51,046,362.03	15.61
17	601988	中国银行	50,205,000.00	15.35
18	000401	冀东水泥	49,714,337.14	15.20
19	002916	深南电路	49,042,381.52	14.99
20	000661	长春高新	48,249,950.60	14.75
21	600498	烽火通信	48,117,567.38	14.71
22	601117	中国化学	47,901,675.19	14.65
23	600028	中国石化	47,802,454.85	14.61
24	600038	中直股份	47,320,465.68	14.47
25	300188	美亚柏科	46,142,018.15	14.11
26	600808	马钢股份	44,899,725.64	13.73
27	601668	中国建筑	44,364,564.24	13.56
28	601111	中国国航	44,100,013.55	13.48
29	600183	生益科技	42,197,032.14	12.90
30	601225	陕西煤业	41,555,256.00	12.70
31	000066	中国长城	41,026,812.13	12.54

32	300170	汉得信息	39,082,423.32	11.95
33	600519	贵州茅台	38,175,635.12	11.67
34	601857	中国石油	37,898,664.48	11.59
35	601998	中信银行	37,820,054.13	11.56
36	000402	金融街	37,638,595.16	11.51
37	601992	金隅集团	37,198,518.95	11.37
38	000333	美的集团	36,819,482.37	11.26
39	600019	宝钢股份	36,141,187.00	11.05
40	300601	康泰生物	36,115,723.52	11.04
41	000977	浪潮信息	36,057,339.16	11.02
42	600068	葛洲坝	34,809,514.41	10.64
43	300414	中光防雷	34,148,882.42	10.44
44	601636	旗滨集团	34,131,536.79	10.44
45	600690	青岛海尔	34,044,028.92	10.41
46	600196	复星医药	33,987,097.24	10.39
47	300383	光环新网	33,611,072.72	10.28
48	600861	北京城乡	32,481,537.69	9.93
49	300550	和仁科技	32,473,244.00	9.93
50	600703	三安光电	32,012,159.06	9.79
51	300450	先导智能	30,837,254.62	9.43
52	600887	伊利股份	30,835,474.08	9.43
53	000022	深赤湾A	30,602,308.04	9.36
54	002027	分众传媒	30,215,388.15	9.24
55	000671	阳光城	29,987,977.00	9.17
56	600030	中信证券	29,807,443.00	9.11
57	002672	东江环保	29,651,154.36	9.07
58	601390	中国中铁	29,640,770.52	9.06
59	002912	中新赛克	29,184,194.73	8.92
60	000672	上峰水泥	28,926,743.80	8.84
61	601800	中国交建	28,741,650.13	8.79
62	300113	顺网科技	28,398,100.43	8.68
63	601899	紫金矿业	27,525,000.00	8.42
64	300016	北陆药业	26,580,484.50	8.13
65	300212	易华录	26,531,193.41	8.11
66	600340	华夏幸福	26,202,583.55	8.01
67	000651	格力电器	26,124,830.08	7.99
68	002456	欧菲科技	26,053,006.80	7.97
69	002410	广联达	25,411,725.71	7.77
70	600271	航天信息	25,191,083.72	7.70
71	002007	华兰生物	25,131,556.16	7.68
72	600125	铁龙物流	24,745,396.92	7.57
73	600036	招商银行	24,471,003.29	7.48
74	600438	通威股份	24,214,072.00	7.40
75	603127	昭衍新药	24,209,912.16	7.40

76	000998	隆平高科	24,191,771.11	7.40
77	601006	大秦铁路	24,189,963.36	7.40
78	000039	中集集团	24,128,598.85	7.38
79	601699	潞安环能	24,075,431.50	7.36
80	600782	新钢股份	23,866,503.00	7.30
81	601328	交通银行	23,693,829.00	7.24
82	002271	东方雨虹	23,480,296.20	7.18
83	300037	新宙邦	23,450,607.86	7.17
84	601088	中国神华	23,249,811.62	7.11
85	000002	万 科 A	23,228,822.58	7.10
86	300253	卫宁健康	22,762,141.95	6.96
87	300687	赛意信息	22,744,352.04	6.95
88	600583	海油工程	22,557,212.37	6.90
89	000786	北新建材	22,513,800.65	6.88
90	002146	荣盛发展	22,384,589.00	6.84
91	300623	捷捷微电	22,253,439.36	6.80
92	300166	东方国信	22,095,555.11	6.76
93	000606	顺利办	22,082,866.96	6.75
94	603929	亚翔集成	21,833,109.49	6.68
95	600893	航发动力	21,573,420.00	6.60
96	600801	华新水泥	21,391,329.81	6.54
97	002463	沪电股份	21,032,878.40	6.43
98	600720	祁连山	20,998,691.83	6.42
99	300373	扬杰科技	20,760,555.28	6.35
100	300199	翰宇药业	20,359,704.66	6.22
101	600343	航天动力	20,235,789.97	6.19
102	300609	汇纳科技	19,870,468.96	6.08
103	600588	用友网络	19,791,379.58	6.05
104	300322	硕贝德	19,719,483.40	6.03
105	601600	中国铝业	19,666,777.00	6.01
106	300699	光威复材	19,597,821.42	5.99
107	000733	振华科技	19,429,886.00	5.94
108	600803	新奥股份	19,326,004.00	5.91
109	002405	四维图新	19,274,708.12	5.89
110	600547	山东黄金	18,947,035.97	5.79
111	603636	南威软件	18,777,054.00	5.74
112	600600	青岛啤酒	18,694,055.43	5.72
113	600335	国机汽车	18,640,646.93	5.70
114	600760	中航沈飞	18,343,287.00	5.61
115	002439	启明星辰	18,308,635.58	5.60
116	600562	国睿科技	18,041,941.90	5.52
117	603659	璞泰来	18,005,515.39	5.50
118	600643	爱建集团	17,945,378.39	5.49
119	000089	深圳机场	17,938,727.20	5.48

120	300122	智飞生物	17,655,302.02	5.40
121	300446	乐凯新材	17,313,815.92	5.29
122	600360	华微电子	17,280,053.05	5.28
123	601818	光大银行	17,000,000.00	5.20
124	300747	锐科激光	16,977,252.26	5.19
125	000513	丽珠集团	16,967,977.95	5.19
126	300059	东方财富	16,941,238.80	5.18
127	002202	金风科技	16,836,047.54	5.15
128	600073	上海梅林	16,805,757.05	5.14
129	300559	佳发教育	16,740,383.21	5.12
130	600879	航天电子	16,625,885.70	5.08
131	002372	伟星新材	16,566,348.20	5.06
132	300348	长亮科技	16,076,230.40	4.92
133	603297	永新光学	15,944,699.07	4.87
134	600050	中国联通	15,940,000.00	4.87
135	601601	中国太保	15,893,167.09	4.86
136	603538	美诺华	15,616,109.94	4.77
137	300607	拓斯达	15,612,753.00	4.77
138	002341	新纶科技	15,423,518.75	4.72
139	002920	德赛西威	15,415,398.20	4.71
140	002786	银宝山新	15,409,643.99	4.71
141	300347	泰格医药	15,351,117.13	4.69
142	002869	金溢科技	15,346,995.36	4.69
143	000547	航天发展	14,946,103.62	4.57
144	300287	飞利信	14,860,920.00	4.54
145	002544	杰赛科技	14,793,482.00	4.52
146	002065	东华软件	14,755,255.00	4.51
147	002308	威创股份	14,754,124.52	4.51
148	000807	云铝股份	14,722,659.00	4.50
149	002029	七匹狼	14,615,569.44	4.47
150	300496	中科创达	14,459,762.70	4.42
151	600606	绿地控股	14,436,698.00	4.41
152	601669	中国电建	14,364,363.92	4.39
153	600702	舍得酒业	14,280,386.00	4.37
154	600584	长电科技	14,223,915.00	4.35
155	601808	中海油服	13,873,383.00	4.24
156	002338	奥普光电	13,522,241.00	4.13
157	601333	广深铁路	13,509,673.00	4.13
158	600033	福建高速	13,491,792.98	4.12
159	000797	中国武夷	13,450,583.23	4.11
160	002470	金正大	13,442,170.00	4.11
161	002675	东诚药业	13,337,114.00	4.08
162	300070	碧水源	13,268,337.76	4.06
163	600809	山西汾酒	13,241,168.90	4.05

164	002698	博实股份	13,240,900.31	4.05
165	600258	首旅酒店	13,208,130.56	4.04
166	600884	杉杉股份	13,179,272.64	4.03
167	600886	国投电力	13,080,539.60	4.00
168	300168	万达信息	12,974,845.19	3.97
169	300017	网宿科技	12,966,364.82	3.96
170	601766	中国中车	12,806,992.83	3.92
171	600495	晋西车轴	12,728,027.60	3.89
172	000898	鞍钢股份	12,710,725.71	3.89
173	002821	凯莱英	12,692,175.00	3.88
174	600582	天地科技	12,646,838.72	3.87
175	603686	龙马环卫	12,628,110.12	3.86
176	000014	沙河股份	12,577,917.00	3.85
177	002373	千方科技	12,548,620.59	3.84
178	300624	万兴科技	12,458,220.07	3.81
179	000858	五 粮 液	12,396,399.00	3.79
180	002236	大华股份	12,235,474.00	3.74
181	000839	中信国安	11,896,364.00	3.64
182	000789	万年青	11,802,292.72	3.61
183	000961	中南建设	11,798,668.00	3.61
184	600845	宝信软件	11,754,037.16	3.59
185	002935	天奥电子	11,716,608.80	3.58
186	300502	新易盛	11,602,767.00	3.55
187	601186	中国铁建	11,305,117.20	3.46
188	601233	桐昆股份	11,303,069.60	3.46
189	600990	四创电子	11,119,172.00	3.40
190	300661	圣邦股份	11,080,492.68	3.39
191	600376	首开股份	11,062,916.28	3.38
192	002661	克明面业	11,034,821.00	3.37
193	000783	长江证券	10,909,846.00	3.34
194	603377	东方时尚	10,872,676.24	3.32
195	600718	东软集团	10,784,470.77	3.30
196	600754	锦江股份	10,723,820.42	3.28
197	300365	恒华科技	10,599,656.39	3.24
198	601688	华泰证券	10,593,845.00	3.24
199	002035	华帝股份	10,579,416.50	3.23
200	600018	上港集团	10,497,154.22	3.21
201	600787	中储股份	10,469,430.00	3.20
202	600570	恒生电子	10,464,540.00	3.20
203	002268	卫 士 通	10,400,455.56	3.18
204	603583	捷昌驱动	10,323,105.25	3.16
205	600967	内蒙一机	10,222,132.98	3.13
206	600779	水井坊	10,194,763.67	3.12
207	002659	凯文教育	10,010,358.60	3.06

208	600885	宏发股份	9,889,762.32	3.02
209	300454	深信服	9,874,444.28	3.02
210	000822	山东海化	9,855,143.00	3.01
211	300431	暴风集团	9,823,632.85	3.00
212	600449	宁夏建材	9,703,856.10	2.97
213	002078	太阳纸业	9,669,914.00	2.96
214	300447	全信股份	9,649,863.50	2.95
215	000983	西山煤电	9,496,710.30	2.90
216	603197	保隆科技	9,483,411.68	2.90
217	002273	水晶光电	9,444,550.20	2.89
218	002224	三力士	9,436,661.95	2.89
219	603357	设计总院	9,432,132.56	2.88
220	300302	同有科技	9,395,383.00	2.87
221	600563	法拉电子	9,348,083.00	2.86
222	600529	山东药玻	9,290,633.04	2.84
223	002343	慈文传媒	9,149,812.00	2.80
224	600085	同仁堂	9,017,129.00	2.76
225	300371	汇中股份	8,987,654.86	2.75
226	603026	石大胜华	8,966,403.89	2.74
227	600282	南钢股份	8,952,052.08	2.74
228	600567	山鹰纸业	8,872,711.40	2.71
229	002897	意华股份	8,858,461.80	2.71
230	000910	大亚圣象	8,848,979.00	2.71
231	600598	北大荒	8,837,871.00	2.70
232	600461	洪城水业	8,650,003.48	2.64
233	300319	麦捷科技	8,632,332.50	2.64
234	300315	掌趣科技	8,603,557.91	2.63
235	600106	重庆路桥	8,497,043.40	2.60
236	600188	兖州煤业	8,482,213.83	2.59
237	300339	润和软件	8,459,303.60	2.59
238	002156	通富微电	8,437,111.80	2.58
239	000799	酒鬼酒	8,392,741.00	2.57
240	000598	兴蓉环境	8,374,918.00	2.56
241	300226	上海钢联	8,360,243.30	2.56
242	002023	海特高新	8,335,911.60	2.55
243	300613	富瀚微	8,293,440.00	2.54
244	002262	恩华药业	8,192,387.10	2.50
245	600677	航天通信	8,162,416.31	2.50
246	600362	江西铜业	8,143,910.00	2.49
247	300448	浩云科技	8,024,267.61	2.45
248	300440	运达科技	8,021,849.00	2.45
249	300331	苏大维格	8,021,795.50	2.45
250	601098	中南传媒	8,016,825.80	2.45
251	600141	兴发集团	7,947,626.08	2.43

252	002508	老板电器	7,907,966.63	2.42
253	600211	西藏药业	7,849,700.70	2.40
254	300671	富满电子	7,805,834.00	2.39
255	300251	光线传媒	7,648,155.54	2.34
256	603505	金石资源	7,623,060.15	2.33
257	002079	苏州固锝	7,593,626.10	2.32
258	603589	口子窖	7,580,615.85	2.32
259	000933	神火股份	7,563,380.05	2.31
260	600694	大商股份	7,513,503.25	2.30
261	300245	天玑科技	7,503,479.50	2.29
262	600137	浪莎股份	7,479,794.60	2.29
263	002559	亚威股份	7,427,052.90	2.27
264	300011	鼎汉技术	7,396,357.00	2.26
265	002677	浙江美大	7,352,783.20	2.25
266	601877	正泰电器	7,276,566.84	2.22
267	002905	金逸影视	7,248,043.00	2.22
268	600691	阳煤化工	7,170,169.00	2.19
269	000546	金圆股份	6,944,466.00	2.12
270	002876	三利谱	6,930,005.92	2.12
271	002643	万润股份	6,900,605.00	2.11
272	002415	海康威视	6,807,802.50	2.08
273	002017	东信和平	6,807,332.54	2.08
274	300732	设研院	6,785,097.40	2.07
275	600115	东方航空	6,748,512.26	2.06
276	600055	万东医疗	6,724,063.51	2.06
277	603777	来伊份	6,664,282.00	2.04
278	600795	国电电力	6,653,603.02	2.03
279	600623	华谊集团	6,595,483.00	2.02
280	002465	海格通信	6,589,288.13	2.01
281	600867	通化东宝	6,552,819.34	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	601939	建设银行	134,912,302.25	41.25
2	002281	光迅科技	120,445,479.36	36.82
3	000768	中航飞机	105,915,455.91	32.38
4	603019	中科曙光	102,356,758.13	31.29

5	600048	保利地产	87,220,743.01	26.67
6	601398	工商银行	81,711,986.24	24.98
7	300567	精测电子	75,666,880.61	23.13
8	001979	招商蛇口	62,418,207.08	19.08
9	600038	中直股份	59,498,388.86	18.19
10	601318	中国平安	58,298,163.16	17.82
11	000932	华菱钢铁	55,770,919.35	17.05
12	601336	新华保险	55,317,046.72	16.91
13	600498	烽火通信	52,693,174.11	16.11
14	000661	长春高新	51,364,343.46	15.70
15	000401	冀东水泥	50,830,052.09	15.54
16	600585	海螺水泥	50,226,998.90	15.36
17	600029	南方航空	49,951,949.53	15.27
18	002916	深南电路	49,331,451.24	15.08
19	601668	中国建筑	47,522,553.44	14.53
20	600028	中国石化	47,156,237.94	14.42
21	000063	中兴通讯	47,100,337.11	14.40
22	601117	中国化学	46,489,778.88	14.21
23	600183	生益科技	44,909,012.61	13.73
24	300188	美亚柏科	44,759,249.36	13.68
25	601111	中国国航	44,675,904.66	13.66
26	600808	马钢股份	44,243,017.65	13.53
27	601998	中信银行	40,716,964.71	12.45
28	600519	贵州茅台	40,218,759.49	12.30
29	601225	陕西煤业	39,159,054.81	11.97
30	000066	中国长城	39,059,134.61	11.94
31	000402	金融街	37,793,427.87	11.55
32	300170	汉得信息	37,723,290.37	11.53
33	000977	浪潮信息	37,683,731.29	11.52
34	601992	金隅集团	37,434,513.97	11.45
35	601857	中国石油	37,276,189.42	11.40
36	600030	中信证券	37,224,003.43	11.38
37	600690	青岛海尔	35,715,344.02	10.92
38	002129	中环股份	35,364,899.01	10.81
39	300601	康泰生物	34,591,908.43	10.58
40	600196	复星医药	34,466,108.73	10.54
41	600019	宝钢股份	34,322,928.56	10.49
42	000333	美的集团	33,469,059.09	10.23
43	600068	葛洲坝	33,386,906.25	10.21
44	601636	旗滨集团	32,118,792.78	9.82
45	600887	伊利股份	32,095,576.58	9.81
46	000022	深赤湾 A	31,103,465.57	9.51
47	300450	先导智能	31,095,112.88	9.51
48	300383	光环新网	30,820,439.62	9.42

49	600703	三安光电	29,173,182.78	8.92
50	000671	阳光城	28,573,498.00	8.74
51	600760	中航沈飞	28,302,579.82	8.65
52	600271	航天信息	28,044,197.86	8.57
53	601800	中国交建	27,866,905.14	8.52
54	300113	顺网科技	27,153,531.97	8.30
55	300212	易华录	26,892,122.40	8.22
56	002456	欧菲科技	26,602,676.32	8.13
57	002027	分众传媒	26,522,602.19	8.11
58	002672	东江环保	26,340,764.74	8.05
59	000651	格力电器	26,135,629.92	7.99
60	000672	上峰水泥	26,066,249.25	7.97
61	600893	航发动力	26,039,616.61	7.96
62	600036	招商银行	25,916,428.00	7.92
63	002463	沪电股份	25,669,054.31	7.85
64	600340	华夏幸福	25,379,496.26	7.76
65	002410	广联达	24,962,268.00	7.63
66	000039	中集集团	24,476,022.84	7.48
67	300016	北陆药业	24,431,304.51	7.47
68	002007	华兰生物	24,302,078.02	7.43
69	601699	潞安环能	24,149,082.70	7.38
70	600801	华新水泥	24,051,246.78	7.35
71	300559	佳发教育	23,912,314.75	7.31
72	603929	亚翔集成	23,902,930.00	7.31
73	300037	新宙邦	23,887,229.52	7.30
74	600782	新钢股份	23,525,629.76	7.19
75	600125	铁龙物流	22,867,360.77	6.99
76	600438	通威股份	22,833,855.47	6.98
77	002271	东方雨虹	22,374,399.59	6.84
78	300373	扬杰科技	22,157,922.41	6.77
79	601988	中国银行	22,020,000.00	6.73
80	300166	东方国信	22,003,324.53	6.73
81	000998	隆平高科	22,000,489.31	6.73
82	300623	捷捷微电	21,350,039.98	6.53
83	000002	万科A	21,157,705.57	6.47
84	300687	赛意信息	20,835,619.30	6.37
85	000786	北新建材	20,641,457.42	6.31
86	600588	用友网络	20,450,725.94	6.25
87	002405	四维图新	20,301,267.90	6.21
88	300122	智飞生物	20,277,602.10	6.20
89	600343	航天动力	20,270,774.32	6.20
90	600583	海油工程	20,175,060.07	6.17
91	600720	祁连山	19,834,729.04	6.06
92	000606	顺利办	19,613,851.76	6.00

93	000733	振华科技	19,585,667.00	5.99
94	300322	硕贝德	19,545,226.26	5.98
95	601600	中国铝业	19,543,030.00	5.98
96	002439	启明星辰	19,253,948.01	5.89
97	300315	掌趣科技	19,213,261.92	5.87
98	300699	光威复材	18,798,821.37	5.75
99	300199	翰宇药业	18,767,333.14	5.74
100	600547	山东黄金	18,397,938.00	5.62
101	600335	国机汽车	18,350,269.23	5.61
102	603538	美诺华	18,186,143.85	5.56
103	600803	新奥股份	17,975,357.43	5.50
104	300347	泰格医药	17,864,711.90	5.46
105	300414	中光防雷	17,202,376.17	5.26
106	603659	璞泰来	17,148,855.46	5.24
107	603297	永新光学	17,148,495.18	5.24
108	300496	中科创达	17,143,024.24	5.24
109	600600	青岛啤酒	17,057,112.66	5.21
110	600990	四创电子	16,967,133.74	5.19
111	600562	国睿科技	16,853,255.60	5.15
112	300446	乐凯新材	16,747,111.28	5.12
113	601818	光大银行	16,706,272.79	5.11
114	002202	金风科技	16,599,310.10	5.08
115	300609	汇纳科技	16,570,047.60	5.07
116	300747	锐科激光	16,538,250.30	5.06
117	002372	伟星新材	16,433,694.78	5.02
118	601601	中国太保	16,386,505.04	5.01
119	300059	东方财富	16,310,904.16	4.99
120	600570	恒生电子	16,201,267.52	4.95
121	600073	上海梅林	16,135,294.49	4.93
122	002341	新纶科技	16,083,900.00	4.92
123	600584	长电科技	15,756,072.33	4.82
124	600879	航天电子	15,735,157.20	4.81
125	600050	中国联通	15,612,438.02	4.77
126	002920	德赛西威	15,516,636.50	4.74
127	600360	华微电子	15,443,915.92	4.72
128	000513	丽珠集团	15,374,317.91	4.70
129	600702	舍得酒业	15,307,947.00	4.68
130	002338	奥普光电	15,234,195.00	4.66
131	000547	航天发展	15,125,902.10	4.62
132	002470	金正大	14,843,464.38	4.54
133	300287	飞利信	14,801,087.35	4.53
134	002065	东华软件	14,773,982.13	4.52
135	601390	中国中铁	14,731,938.72	4.50
136	300348	长亮科技	14,689,956.14	4.49

137	601766	中国中车	14,651,572.00	4.48
138	002544	杰赛科技	14,583,152.00	4.46
139	002343	慈文传媒	14,336,160.72	4.38
140	002869	金溢科技	14,236,228.98	4.35
141	603127	昭衍新药	14,167,156.19	4.33
142	601669	中国电建	14,112,185.19	4.31
143	300168	万达信息	13,929,135.37	4.26
144	002786	银宝山新	13,927,499.75	4.26
145	000807	云铝股份	13,910,495.00	4.25
146	600258	首旅酒店	13,886,637.00	4.25
147	300607	拓斯达	13,863,743.40	4.24
148	300070	碧水源	13,845,529.06	4.23
149	600809	山西汾酒	13,823,507.24	4.23
150	300413	芒果超媒	13,726,771.36	4.20
151	000014	沙河股份	13,549,110.00	4.14
152	300624	万兴科技	13,419,873.30	4.10
153	601952	苏垦农发	13,240,633.64	4.05
154	002029	七匹狼	13,220,458.53	4.04
155	000858	五粮液	13,195,153.00	4.03
156	600606	绿地控股	13,108,983.00	4.01
157	002146	荣盛发展	12,861,103.95	3.93
158	300017	网宿科技	12,852,429.65	3.93
159	002308	威创股份	12,824,178.82	3.92
160	600884	杉杉股份	12,778,347.46	3.91
161	600495	晋西车轴	12,640,027.66	3.86
162	000898	鞍钢股份	12,543,000.00	3.83
163	002821	凯莱英	12,461,470.28	3.81
164	000797	中国武夷	12,224,542.89	3.74
165	600582	天地科技	12,122,965.28	3.71
166	600967	内蒙一机	12,039,424.64	3.68
167	601333	广深铁路	12,035,200.00	3.68
168	000961	中南建设	12,023,831.00	3.68
169	601088	中国神华	11,965,113.64	3.66
170	002373	千方科技	11,960,001.54	3.66
171	000789	万年青	11,927,150.68	3.65
172	603686	龙马环卫	11,855,756.40	3.62
173	601808	中海油服	11,812,967.41	3.61
174	600643	爱建集团	11,741,616.06	3.59
175	300253	卫宁健康	11,662,865.51	3.57
176	002935	天奥电子	11,503,545.08	3.52
177	002675	东诚药业	11,425,029.00	3.49
178	600754	锦江股份	11,356,830.59	3.47
179	601233	桐昆股份	11,329,166.40	3.46
180	600779	水井坊	11,282,596.00	3.45

181	300661	圣邦股份	11,262,659.80	3.44
182	600718	东软集团	11,095,730.00	3.39
183	000839	中信国安	11,077,483.00	3.39
184	000783	长江证券	11,042,543.00	3.38
185	600845	宝信软件	10,960,445.43	3.35
186	002236	大华股份	10,912,672.73	3.34
187	002661	克明面业	10,893,681.80	3.33
188	600018	上港集团	10,821,518.48	3.31
189	002035	华帝股份	10,805,017.50	3.30
190	300365	恒华科技	10,641,016.92	3.25
191	300502	新易盛	10,639,203.00	3.25
192	600885	宏发股份	10,628,933.60	3.25
193	600529	山东药玻	10,531,827.50	3.22
194	002268	卫士通	10,453,633.28	3.20
195	300302	同有科技	10,334,418.00	3.16
196	300659	中孚信息	10,131,548.68	3.10
197	603583	捷昌驱动	10,076,728.95	3.08
198	601688	华泰证券	10,026,153.64	3.07
199	000983	西山煤电	10,025,250.26	3.07
200	603900	莱绅通灵	9,875,656.40	3.02
201	600563	法拉电子	9,705,261.66	2.97
202	000822	山东海化	9,629,526.00	2.94
203	600449	宁夏建材	9,547,628.36	2.92
204	002078	太阳纸业	9,539,245.68	2.92
205	600033	福建高速	9,505,449.96	2.91
206	002659	凯文教育	9,495,004.04	2.90
207	300251	光线传媒	9,481,536.00	2.90
208	600461	洪城水业	9,478,884.08	2.90
209	002156	通富微电	9,329,132.76	2.85
210	600787	中储股份	9,328,924.66	2.85
211	600567	山鹰纸业	9,320,880.48	2.85
212	300447	全信股份	9,271,588.02	2.83
213	300431	暴风集团	9,214,761.80	2.82
214	600388	龙净环保	9,187,995.00	2.81
215	600282	南钢股份	9,132,531.00	2.79
216	603357	设计总院	9,087,477.50	2.78
217	300558	贝达药业	8,953,488.00	2.74
218	600106	重庆路桥	8,923,799.24	2.73
219	300319	麦捷科技	8,844,095.47	2.70
220	300454	深信服	8,825,750.80	2.70
221	002023	海特高新	8,813,698.65	2.69
222	600085	同仁堂	8,809,210.00	2.69
223	002897	意华股份	8,730,354.08	2.67
224	300371	汇中股份	8,653,104.95	2.65

225	000799	酒鬼酒	8,609,609.00	2.63
226	000598	兴蓉环境	8,499,660.00	2.60
227	603505	金石资源	8,459,886.19	2.59
228	000910	大亚圣象	8,383,620.72	2.56
229	601098	中南传媒	8,345,335.16	2.55
230	600598	北大荒	8,316,734.45	2.54
231	002273	水晶光电	8,256,896.80	2.52
232	603728	鸣志电器	8,242,182.56	2.52
233	603197	保隆科技	8,235,020.56	2.52
234	600677	航天通信	8,230,692.91	2.52
235	300339	润和软件	8,185,954.76	2.50
236	300226	上海钢联	8,156,174.66	2.49
237	600188	兖州煤业	8,132,907.99	2.49
238	300613	富瀚微	8,092,045.00	2.47
239	002224	三力士	8,048,997.15	2.46
240	300440	运达科技	8,044,440.00	2.46
241	603026	石大胜华	8,022,680.00	2.45
242	002912	中新赛克	7,932,766.59	2.43
243	300331	苏大维格	7,913,300.60	2.42
244	600362	江西铜业	7,878,732.26	2.41
245	002508	老板电器	7,856,482.40	2.40
246	603589	口子窖	7,824,588.50	2.39
247	002262	恩华药业	7,823,663.79	2.39
248	000800	一汽轿车	7,772,854.00	2.38
249	002905	金逸影视	7,715,427.00	2.36
250	300011	鼎汉技术	7,586,809.09	2.32
251	300245	天玑科技	7,576,404.68	2.32
252	300452	山河药辅	7,576,280.00	2.32
253	600137	浪莎股份	7,525,530.39	2.30
254	300463	迈克生物	7,451,675.00	2.28
255	600211	西藏药业	7,431,552.00	2.27
256	002079	苏州固锔	7,340,837.40	2.24
257	601899	紫金矿业	7,324,911.00	2.24
258	002677	浙江美大	7,312,647.56	2.24
259	000933	神火股份	7,203,213.00	2.20
260	300732	设研院	7,184,397.10	2.20
261	600055	万东医疗	7,164,752.41	2.19
262	002573	清新环境	7,158,299.00	2.19
263	600136	当代明诚	7,119,699.80	2.18
264	300671	富满电子	7,100,124.20	2.17
265	002559	亚威股份	7,084,313.07	2.17
266	002465	海格通信	7,025,920.93	2.15
267	601877	正泰电器	6,984,559.00	2.14
268	600691	阳煤化工	6,982,387.36	2.13

269	002415	海康威视	6,945,800.00	2.12
270	002643	万润股份	6,938,418.50	2.12
271	600795	国电电力	6,822,704.32	2.09
272	600115	东方航空	6,789,406.10	2.08
273	601328	交通银行	6,787,355.00	2.08
274	600141	兴发集团	6,757,091.65	2.07
275	600623	华谊集团	6,649,922.00	2.03
276	002017	东信和平	6,611,529.60	2.02

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	6,731,420,639.77
卖出股票的收入（成交）总额	6,345,462,662.99

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	21,792,000.00	2.15
	其中：政策性金融债	21,792,000.00	2.15
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	21,792,000.00	2.15

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	200,000	21,792,000.00	2.15

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投资。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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**

本报告期末本基金尚无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金尚无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金合同尚无国债期货投资政策。

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	1,087,004.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	960,205.14
5	应收申购款	96,547,439.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	98,594,649.21

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金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

本报告期末本基金前十名股票中未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
15,410	66,085.95	762,850,665.55	74.91%	255,533,897.95	25.09%

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	238,014.97	0.02%

注：本公司所有从业人员持有本基金份额总量为 238014.97 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(2008年7月25日)基金份额总额	278,333,456.06
本报告期期初基金份额总额	250,262,325.30
本报告期基金总申购份额	859,788,664.74
减：本报告期基金总赎回份额	91,666,426.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,018,384,563.50

§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。

本报告期内，本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

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无改变。

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

本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受处罚的情况。

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	
华西证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	1,200,349,410.18	9.19%	877,819.07	8.40%	-
东吴证券	1	1,139,717,238.03	8.72%	833,478.62	7.98%	-
恒泰证券	2	1,121,586,222.25	8.58%	914,845.10	8.76%	-
中金公司	1	908,683,798.51	6.95%	846,259.05	8.10%	-
华泰证券	1	908,065,599.70	6.95%	664,065.13	6.36%	-
天风证券	1	885,689,318.96	6.78%	647,707.32	6.20%	-
东兴证券	2	838,741,845.87	6.42%	613,364.89	5.87%	-
国泰君安	1	657,026,611.69	5.03%	611,889.60	5.86%	-
兴业证券	1	478,368,380.82	3.66%	445,504.76	4.26%	-
齐鲁证券	1	462,816,410.35	3.54%	431,020.28	4.13%	-
信达证券	1	443,463,358.34	3.39%	324,305.50	3.10%	-

国金证券	1	431,137,811.79	3.30%	401,518.35	3.84%	-
中信建投	1	397,241,133.26	3.04%	290,503.38	2.78%	-
银河证券	1	386,177,266.61	2.96%	282,412.46	2.70%	-
安信证券	1	370,514,816.78	2.84%	270,957.90	2.59%	-
华创证券	2	348,779,073.02	2.67%	255,062.67	2.44%	-
东方证券	1	346,077,109.15	2.65%	253,085.57	2.42%	-
中信证券	2	283,943,703.42	2.17%	264,436.15	2.53%	-
川财证券	1	278,362,082.23	2.13%	203,567.52	1.95%	-
申银万国	1	211,713,577.87	1.62%	197,167.77	1.89%	-
光大证券	1	182,704,606.97	1.40%	170,153.54	1.63%	-
渤海证券	1	174,874,413.44	1.34%	127,886.43	1.22%	-
平安证券	1	136,368,539.31	1.04%	127,000.64	1.22%	-
国盛证券	2	131,101,790.70	1.00%	95,874.88	0.92%	-
民生证券	2	118,099,200.76	0.90%	86,365.86	0.83%	-
新时代证券	2	115,359,958.29	0.88%	107,434.69	1.03%	-
招商证券	1	110,173,025.58	0.84%	102,604.12	0.98%	-

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41个交易席位，其中报告期内新增7个交易席位，新增交易席位为：中投证券上海和深圳交易席位、国盛证券上海和深圳交易席位、中银国际证券上海和深圳交易席位、东兴证券深圳交易席位，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。

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
恒泰证券	-	-	510,000,000.00	31.10%	-	-
中金公司	-	-	430,000,000.00	26.22%	-	-
华泰证券	-	-	180,000,000.00	10.98%	-	-
东兴证券	-	-	230,000,000.00	14.02%	-	-
国金证券	-	-	100,000,000.00	6.10%	-	-
安信证券	-	-	50,000,000.00	3.05%	-	-
华创证券	-	-	100,000,000.00	6.10%	-	-
申银万国	-	-	40,000,000.00	2.44%	-	-

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 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		20%的时间区间					
机构	1	20180423-20180704	0.00	146,298,392.72	0.00	146,298,392.72	14.37%
	2	20181101-20181116	0.00	202,662,424.31	0.00	202,662,424.31	19.90%
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

本报告期内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