

新华策略精选股票型证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，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 2017 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	错误! 未定义书签。
2.2 基金产品说明.....	错误! 未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人.....	错误! 未定义书签。
2.4 信息披露方式.....	错误! 未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	错误! 未定义书签。
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	错误! 未定义书签。
3.2 基金净值表现.....	错误! 未定义书签。
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	错误! 未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	错误! 未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	错误! 未定义书签。
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.....	错误! 未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	错误! 未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	错误! 未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	错误! 未定义书签。
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	错误! 未定义书签。
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.....	错误! 未定义书签。
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	错误! 未定义书签。
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	错误! 未定义书签。
6.2 利润表.....	错误! 未定义书签。
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	错误! 未定义书签。
6.4 报表附注.....	错误! 未定义书签。
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	错误! 未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	错误! 未定义书签。
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误! 未定义书签。
7.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误! 未定义书签。
7.5 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误! 未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	错误! 未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	错误! 未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	错误! 未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	错误! 未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	错误! 未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	错误! 未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	错误! 未定义书签。
7.13 投资组合报告附注.....	错误! 未定义书签。
8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	错误! 未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误！未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	错误！未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	错误！未定义书签。
9 开放式基金份额变动.....	41
10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	错误！未定义书签。
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	错误！未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	错误！未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变.....	错误！未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	错误！未定义书签。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	错误！未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	错误！未定义书签。
10.8 其他重大事件.....	错误！未定义书签。
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
12 备查文件目录.....	错误！未定义书签。
12.1 备查文件目录.....	错误！未定义书签。
12.2 存放地点.....	错误！未定义书签。
12.3 查阅方式.....	错误！未定义书签。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华策略精选股票型证券投资基金
基金简称	新华策略精选股票
基金主代码	001040
交易代码	001040
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 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
报告期末基金份额总额	1,049,357,252.85 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握整体市场和行业中的机会，精选投资策略，寻找具有行业增长潜力和价值低估的优质上市公司进行投资，在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续、稳定增长。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采用自上而下与自下而上相结合的主动投资策略，深入分析并积极跟踪驱动股票市场、行业板块、公司股价形成上升趋势的根本性因素，通过前瞻性地把握市场中存在的趋势机会，入手选择具有长期可持续成长能力的股票。</p>
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率 +20%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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	林葛
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816

注册地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	400010	100031
法定代表人	陈重	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-118,548,159.82
本期利润	-2,408,924.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0022
本期加权平均净值利润率	-0.22%
本期基金份额净值增长率	-0.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-118,563,452.28
期末可供分配基金份额利润	-0.1130
期末基金资产净值	1,023,829,726.08
期末基金份额净值	0.976
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-2.40%

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
过去一个月	5.40%	0.90%	4.01%	0.54%	1.39%	0.36%
过去三个月	-1.71%	0.83%	4.90%	0.49%	-6.61%	0.34%
过去六个月	-0.41%	0.77%	8.65%	0.45%	-9.06%	0.32%
过去一年	8.08%	0.77%	13.30%	0.54%	-5.22%	0.23%
自基金合同生效起至今	-2.40%	1.93%	-5.45%	1.46%	3.05%	0.47%

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%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

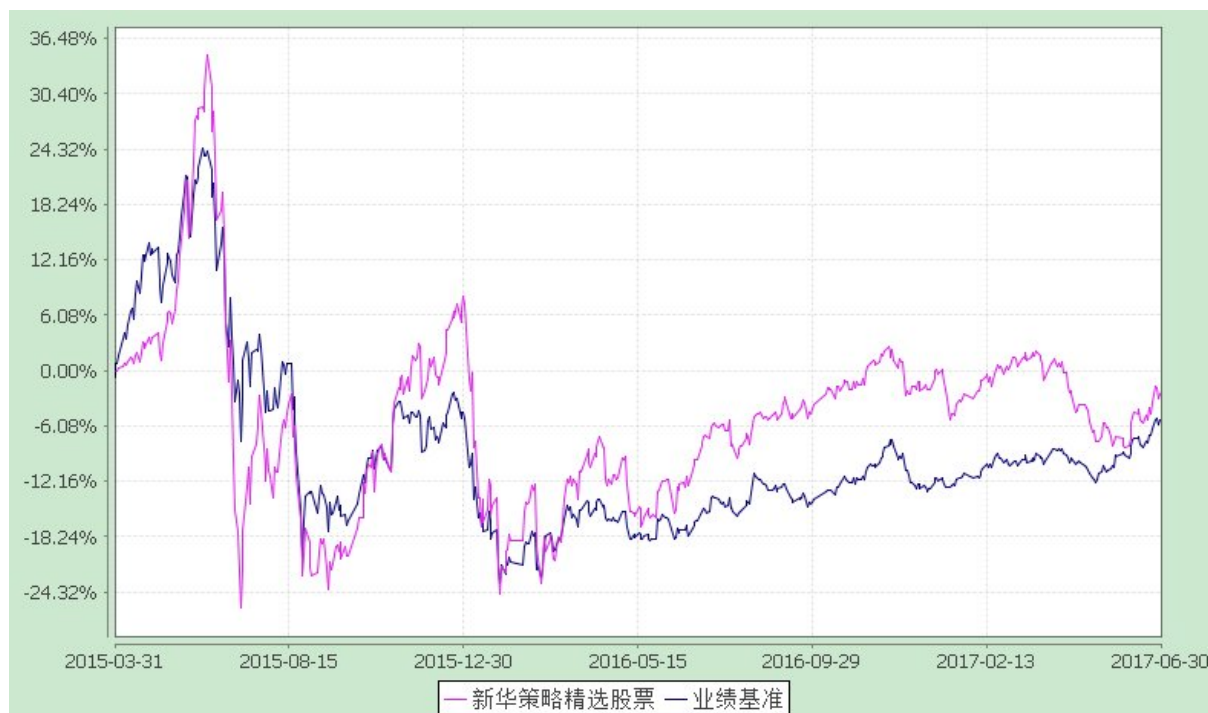
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华策略精选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 3 月 31 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2015 年 3 月 31 日生效。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。

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 2017 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十七只开放式基金，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、新华信用增益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、新华阿里一号保本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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、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、新华阿鑫二号保本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、新华信用增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫锐混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫盛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、新华华盛灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫丰灵活配置混合型证券投资基金和新华鑫裕灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵强	本基金基金经理，新华优选分红混合型证券投资基金基金经理。	2017-05-17	-	14	管理学硕士，14 年证券从业经验。历任国金基金高级研究员、英大基金基金经理、中欧基金投资经理，2016 年 11 月加入新华基金管理股份有限公司，现任新华优选分红混合型证券投资基金基金经理、新华策略精选股票型证券投资基金基金经理。
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、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-07-16	2017-05-23	8	硕士研究生，8 年证券从业经验。2008 年 7 月加入新华基金管理股份有限公司，历任新华基金管理股份有限公司研究部行业分析师、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
崔建波	本基金基金经	2015-03-3	2017-05-26	22	经济学硕士，历任天津中融证券投

	理，新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监、权益投资部总监、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华稳健回报灵活配置混合型发起式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、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	1			资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、海融资讯系统有限公司研究员、和讯信息科技有限公司证券研究部、理财服务部经理、北方国际信托股份有限公司投资部信托高级投资经理。现任新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监、权益投资部总监、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华稳健回报灵活配置混合型发起式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、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
杨祺	本基金基金经理助理。	2017-01-20	-	5	工商管理硕士，5 年证券从业经历。历任华为技术有限公司产品经理、国泰基金管理有限公司研究员、圆信永丰基金管理有限公司研究员。2015 年 5 月加入新华基金

					管理股份有限公司,任研究员、tmt 组组长,现任新华策略精选股票型证券投资基金基金经理助理。
钟俊	本基金基金经理助理。	2017-01-20	-	9	金融学硕士,9 年证券从业经历。历任新华基金风险与量化研究员,行业研究员、行业组长。先后负责电力设备新能源、电力与环保、金融、商贸、农业、交通运输等多个行业研究,现任新华策略精选股票型证券投资基金基金经理助理。

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策略精选股票型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华策略精选股票型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理有限公司公平交易制度指导意见》(2011 年修订),公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易,投资指令统一由交易部下达,并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议,由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会会议,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令,交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现重大异常情况，且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，中国经济保持稳定增长，通胀水平较低，出口与消费都维持较快增速，与此同时上游资源品在供给侧改革和环保压力下，价格出现大幅上升。展望下半年，十九大即将召开，政策以稳健为主，中国经济在投资保持一定增速和外需较好的背景下，继续会保持平稳增长。

上半年本基金调仓力度较大，在行业选择上，重点配置了稳健成长的白马蓝筹股，重点配置了地产、家电、白酒、建筑建材、医药等五个子行业。在公司选择上，我们坚持选择具备竞争优势的白马龙头公司。通过深入的基本面和财务分析，把公司的投入资本回报率（ROIC）和公司业绩增速（g）与公司估值（pe）三者结合起来甄选个股，特别是高 ROIC、经营现金流良好的优质公司是重点配置的对象。我们坚信，随着时间的推移，优质公司一定会给投资者创造良好的回报，虽然这种过程有可能会经历一定的等待和忍耐。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.976 元，本报告期份额净值增长率为-0.41%，同期比较基准的增长率为 8.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在下半年的投资中，我们将继续去寻找能够穿越股市周期的价值成长型公司进行长期投资，风物长宜放眼量，不畏短期波动，不去追风，不去博弈。特别是短期市场热点的轮换，造成优质白马公司的暂时调整，为我们提供了难得的介入时机。我们对中国经济的长期前景保持乐观，中国也必将涌现出众多能给投资者带来丰厚回报的优质白马公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、估值工作小组的职责分工

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

估值工作小组职责：

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

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

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

二、基金会计的职责分工

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

基金会计职责：

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

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

四、交易部的职责分工

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

五、监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华策略精选股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	109,487,748.86	93,123,295.08
结算备付金		3,070,394.73	2,254,055.10
存出保证金		280,734.41	426,980.44
交易性金融资产	6.4.7.2	911,542,802.06	1,066,247,219.54
其中：股票投资		911,542,802.06	1,066,247,219.54
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,164,027.83	-
应收利息	6.4.7.5	17,455.86	21,028.61
应收股利		-	-
应收申购款		35,232.99	13,865.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,028,598,396.74	1,162,086,443.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	6,030,667.35
应付赎回款		795,643.72	1,553,790.68
应付管理人报酬		1,235,868.05	1,491,166.47
应付托管费		205,978.02	248,527.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,302,755.83	1,539,013.96
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	228,425.04	261,815.76
负债合计		4,768,670.66	11,124,981.96
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,049,357,252.85	1,174,123,608.18
未分配利润	6.4.7.10	-25,527,526.77	-23,162,146.31
所有者权益合计		1,023,829,726.08	1,150,961,461.87
负债和所有者权益总计		1,028,598,396.74	1,162,086,443.83

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.976 元，基金份额总额 1,049,357,252.85 份。

6.2 利润表

会计主体：新华策略精选股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		11,399,584.86	-218,572,537.52
1.利息收入		495,054.14	446,876.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	388,793.55	446,876.66
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		106,260.59	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-105,312,756.24	-16,605,473.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-112,390,241.36	-22,904,148.66
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	6.4.7.13	7,077,485.12	6,298,675.08
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	116,139,235.21	-202,831,158.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	78,051.75	417,217.96
减：二、费用		13,808,509.47	12,618,638.37
1. 管理人报酬		8,020,789.04	9,068,248.76
2. 托管费		1,336,798.18	1,511,374.85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.16	4,199,691.37	1,800,456.63
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.17	251,230.88	238,558.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,408,924.61	-231,191,175.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,408,924.61	-231,191,175.89

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华策略精选股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,174,123,608.18	-23,162,146.31	1,150,961,461.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,408,924.61	-2,408,924.61
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）	-124,766,355.33	43,544.15	-124,722,811.18
其中：1.基金申购款	26,157,539.23	-666,583.95	25,490,955.28
2.基金赎回款	-150,923,894.56	710,128.10	-150,213,766.46
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	1,049,357,252.85	-25,527,526.77	1,023,829,726.08

项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,390,153,354.05	100,814,764.55	1,490,968,118.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-231,191,175.89	-231,191,175.89
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）	-8,915,830.17	-3,185,163.51	-12,100,993.68
其中：1.基金申购款	128,954,473.80	-16,804,177.07	112,150,296.73
2.基金赎回款	-137,870,303.97	13,619,013.56	-124,251,290.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,381,237,523.88	-133,561,574.85	1,247,675,949.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华策略精选股票型证券投资基金(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[2015]66 号文件“关于核准新华策略精选股票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 2015 年 3 月 9 日至 3 月 27 日向社会公开募集，首次募集资金总额 4,069,427,511.95 元，其中募集净认购资金金额 4,068,919,005.90 元，募集资金产生利息 508,506.05 元，并经瑞华会计师事务所有限公司瑞华验字[2015]第 37100004 号验资报告予以验证。2015 年 3 月 31 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不限定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华策略精选股票型证券投资基金招募说明书》及《新华策略精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象为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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金股票资产投资比例为基金资产的 80%—95%；其中持有的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

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 2017 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 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与上年度一致、会计估计与上年度一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

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

2、营业税、增值税、企业所得税

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

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

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时，对个人持股 1 年以内（含 1 年）的，上市公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	109,487,748.86
定期存款	-
其他存款	-
合计	109,487,748.86

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	843,703,310.01	911,542,802.06	67,839,492.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	843,703,310.01	911,542,802.06	67,839,492.05

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	16,098.66
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	1,357.20
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	17,455.86

注：应收结算备付金利息中包含结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,302,755.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,302,755.83

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	316.17
其他应付款	-
预提费用	228,108.87
合计	228,425.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,174,123,608.18	1,174,123,608.18
本期申购	26,157,539.23	26,157,539.23
本期赎回（以“-”号填列）	-150,923,894.56	-150,923,894.56
本期末	1,049,357,252.85	1,049,357,252.85

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,887,151.31	-21,274,995.00	-23,162,146.31
本期利润	-118,548,159.82	116,139,235.21	-2,408,924.61
本期基金份额交易产生的变动数	1,871,858.85	-1,828,314.70	43,544.15
其中：基金申购款	-421,889.49	-244,694.46	-666,583.95
基金赎回款	2,293,748.34	-1,583,620.24	710,128.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-118,563,452.28	93,035,925.51	-25,527,526.77

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	371,723.93
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17,069.62
其他	-
合计	388,793.55

注：结算备付金利息收入中包含结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,527,589,583.31
减：卖出股票成本总额	1,639,979,824.67
买卖股票差价收入	-112,390,241.36

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,077,485.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,077,485.12

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	116,139,235.21
——股票投资	116,139,235.21
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	116,139,235.21

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	76,713.59
转换费收入	1,338.16
合计	78,051.75

6.4.7.16 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	4,199,691.37
银行间市场交易费用	-
合计	4,199,691.37

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	188,437.29
债券账户维护费	9,000.00
汇划手续费	14,122.01
其他	-
合计	251,230.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
恒泰证券	85,044,196.53	2.83%	183,410,185.70	15.31%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
恒泰证券	75,420.90	3.12%	61,594.91	2.67%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
恒泰证券	140,476.25	13.34%	676,647.41	29.23%

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,020,789.04	9,068,248.76
其中：支付销售机构的客户维护费	3,854,659.96	4,346,225.00

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，上年度可比期间列示的支付销售机构的客户维护费为当期支付金额。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,336,798.18	1,511,374.85

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。

6.4.10.3 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，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
期初持有的基金份额	12,134,708.74	12,134,708.74
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	12,134,708.74	12,134,708.74
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.16%	0.88%

6.4.10.4.2 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

报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	109,487,748.86	371,723.93	151,062,046.57	428,114.16

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期间无收益分配事项。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下中签	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下中签	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下中签	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下中签	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下中签	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下中签	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下中签	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 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
603238	诺邦股份	2017-05-15	筹划重大事项, 停牌	29.38	2017-08-23	31.99	1,750.00	23,292.50	51,415.00	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大资产重组, 停牌	16.31	2017-08-02	16.48	569,397.00	6,156,023.43	9,286,865.07	-
300518	盛讯达	2016-12-13	重大资产重组, 停牌	113.30	2017-07-10	101.97	1,306.00	29,019.32	147,969.80	-
002576	通达动力	2017-01-23	重大资产重组,	24.66	-	-	300,100.00	8,854,892.40	7,400,466.00	-

			停牌							
603010	万盛股份	2016-12-26	重大资产重组, 停牌	40.36	2017-07-20	36.32	129,280.00	1,828,234.42	5,217,740.80	-
603016	新宏泰	2017-05-02	重大资产重组, 停牌	28.60	-	-	1,602.00	13,600.98	45,817.20	-
300087	荃银高科	2017-05-12	重大资产重组, 停牌	14.14	2017-08-10	9.80	50,000.00	605,620.00	707,000.00	-
002586	围海股份	2017-04-18	重大资产重组, 停牌	9.87	-	-	1,075,000.00	10,769,282.63	10,610,250.00	-
300065	海兰信	2016-12-08	筹划重大事项, 停牌	25.63	2017-07-06	23.07	74,973.00	1,774,569.18	1,921,557.99	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基

金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-------------------	------	------	------	-----	----

资产					
银行存款	109,487,748.86	-	-	-	109,487,748.86
结算备付金	3,070,394.73	-	-	-	3,070,394.73
存出保证金	280,734.41	-	-	-	280,734.41
交易性金融资产	-	-	-	911,542,802.06	911,542,802.06
应收证券清算款	-	-	-	4,164,027.83	4,164,027.83
应收利息	-	-	-	17,455.86	17,455.86
应收申购款	-	-	-	35,232.99	35,232.99
资产总计	112,838,878.00	-	-	915,759,518.74	1,028,598,396.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	795,643.72	795,643.72
应付管理人报酬	-	-	-	1,235,868.05	1,235,868.05
应付托管费	-	-	-	205,978.02	205,978.02
应付交易费用	-	-	-	2,302,755.83	2,302,755.83
其他负债	-	-	-	228,425.04	228,425.04
负债总计	-	-	-	4,768,670.66	4,768,670.66
利率敏感度缺口	112,838,878.00	-	-	910,990,848.08	1,023,829,726.08
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	93,123,295.08	-	-	-	93,123,295.08
结算备付金	2,254,055.10	-	-	-	2,254,055.10
存出保证金	426,980.44	-	-	-	426,980.44
交易性金融资产	-	-	-	1,066,247,219.54	1,066,247,219.54
应收利息	-	-	-	21,028.61	21,028.61
应收申购款	-	-	-	13,865.06	13,865.06
资产总计	95,804,330.62	-	-	1,066,282,113.21	1,162,086,443.83
负债					

应付证券清算款	-	-	-	6,030,667.35	6,030,667.35
应付赎回款	-	-	-	1,553,790.68	1,553,790.68
应付管理人报酬	-	-	-	1,491,166.47	1,491,166.47
应付托管费	-	-	-	248,527.74	248,527.74
应付交易费用	-	-	-	1,539,013.96	1,539,013.96
其他负债	-	-	-	261,815.76	261,815.76
负债总计	-	-	-	11,124,981.96	11,124,981.96
利率敏感度缺口	95,804,330.62	-	-	1,055,157,131.25	1,150,961,461.87

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点		
	其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	增加约 28	增加约 24
	市场利率下降 25.00 bp	减少约 28	减少约 24

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	911,542,802.06	89.03	1,066,247,219.54	92.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	911,542,802.06	89.03	1,066,247,219.54	92.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,本基金业绩比较基准上升 1%		
	其他市场变量不变,本基金业绩比较基准下降 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	本基金业绩比较基准上升 1%	增加约 1,042	增加约 1,219
	本基金业绩比较基准下降 1%	减少约 1,042	减少约 1,219

7 投资组合报告

7.1 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	911,542,802.06	88.62
	其中: 股票	911,542,802.06	88.62

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	112,558,143.59	10.94
7	其他各项资产	4,497,451.09	0.44
8	合计	1,028,598,396.74	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	707,000.00	0.07
B	采矿业	7,690,000.00	0.75
C	制造业	535,746,924.33	52.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	78,644,588.46	7.68
F	批发和零售业	43,532,629.50	4.25
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,968,420.16	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,589,465.92	1.13
J	金融业	45,590,359.07	4.45
K	房地产业	154,556,221.40	15.10
L	租赁和商务服务业	9,083,847.12	0.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,107,346.10	1.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	2,326,000.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	911,542,802.06	89.03

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末，本基金未持有港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	001979	招商蛇口	1,851,923	39,557,075.28	3.86
2	000002	万科A	1,350,113	33,712,321.61	3.29
3	600201	生物股份	885,253	31,488,449.21	3.08
4	002007	华兰生物	800,000	29,200,000.00	2.85
5	600739	辽宁成大	1,586,650	28,607,299.50	2.79
6	000418	小天鹅A	599,860	28,067,449.40	2.74
7	600809	山西汾酒	734,029	25,463,466.01	2.49
8	002051	中工国际	1,220,478	25,300,508.94	2.47
9	600048	保利地产	2,216,000	22,093,520.00	2.16
10	000065	北方国际	899,876	21,399,051.28	2.09
11	601668	中国建筑	2,200,000	21,296,000.00	2.08
12	000069	华侨城A	1,799,935	18,107,346.10	1.77
13	002508	老板电器	399,775	17,382,217.00	1.70
14	000568	泸州老窖	337,380	17,064,680.40	1.67
15	601601	中国太保	500,000	16,935,000.00	1.65
16	000858	五粮液	300,000	16,698,000.00	1.63
17	601799	星宇股份	373,105	16,498,703.10	1.61
18	002572	索菲亚	400,000	16,400,000.00	1.60
19	600801	华新水泥	1,713,082	16,325,671.46	1.59
20	600690	青岛海尔	1,051,822	15,829,921.10	1.55
21	000402	金融街	1,299,968	15,235,624.96	1.49
22	002372	伟星新材	784,104	14,647,062.72	1.43
23	600779	水井坊	566,623	13,927,593.34	1.36
24	600266	北京城建	900,000	13,086,000.00	1.28
25	000581	威孚高科	500,034	12,950,880.60	1.26
26	600271	航天信息	599,908	12,382,101.12	1.21
27	600325	华发股份	1,466,073	12,241,709.55	1.20
28	300628	亿联网络	40,000	12,158,400.00	1.19

29	300418	昆仑万维	499,950	11,433,856.50	1.12
30	600566	济川药业	296,300	11,268,289.00	1.10
31	600015	华夏银行	1,200,000	11,064,000.00	1.08
32	000807	云铝股份	1,499,901	10,829,285.22	1.06
33	002586	围海股份	1,075,000	10,610,250.00	1.04
34	002841	视源股份	142,512	10,577,240.64	1.03
35	000921	海信科龙	600,000	10,326,000.00	1.01
36	600185	格力地产	1,500,000	10,185,000.00	0.99
37	000423	东阿阿胶	140,500	10,100,545.00	0.99
38	600161	天坛生物	259,888	10,086,253.28	0.99
39	603566	普莱柯	399,957	9,702,956.82	0.95
40	600643	爱建集团	569,397	9,286,865.07	0.91
41	601888	中国国旅	300,000	9,042,000.00	0.88
42	601600	中国铝业	2,000,000	9,040,000.00	0.88
43	603833	欧派家居	81,429	8,945,789.94	0.87
44	601155	新城控股	455,500	8,444,970.00	0.82
45	603898	好莱客	233,027	8,144,293.65	0.80
46	600702	沱牌舍得	300,000	7,983,000.00	0.78
47	603816	顾家家居	134,348	7,896,975.44	0.77
48	603337	杰克股份	200,000	7,740,000.00	0.76
49	601168	西部矿业	1,000,000	7,690,000.00	0.75
50	002206	海利得	1,012,000	7,519,160.00	0.73
51	300072	三聚环保	200,000	7,410,000.00	0.72
52	002576	通达动力	300,100	7,400,466.00	0.72
53	600132	重庆啤酒	295,000	6,876,450.00	0.67
54	000333	美的集团	137,805	5,931,127.20	0.58
55	601607	上海医药	202,440	5,846,467.20	0.57
56	000910	大亚圣象	234,100	5,815,044.00	0.57
57	603600	永艺股份	333,653	5,491,928.38	0.54
58	600176	中国巨石	500,000	5,490,000.00	0.54
59	603010	万盛股份	129,280	5,217,740.80	0.51
60	600309	万华化学	180,000	5,155,200.00	0.50
61	601933	永辉超市	724,430	5,128,964.40	0.50
62	000970	中科三环	288,508	4,264,148.24	0.42
63	002032	苏泊尔	100,000	4,105,000.00	0.40
64	002718	友邦吊顶	69,000	4,019,250.00	0.39
65	600258	首旅酒店	169,881	3,968,420.16	0.39
66	002419	天虹股份	274,680	3,949,898.40	0.39
67	600062	华润双鹤	140,600	3,856,658.00	0.38
68	601318	中国平安	76,000	3,770,360.00	0.37
69	600197	伊力特	178,000	3,476,340.00	0.34
70	600699	均胜电子	100,000	3,209,000.00	0.31
71	603818	曲美家居	200,000	3,186,000.00	0.31
72	000661	长春高新	20,000	2,582,200.00	0.25

73	300015	爱尔眼科	100,000	2,326,000.00	0.23
74	300003	乐普医疗	100,000	2,211,000.00	0.22
75	603737	三棵树	33,848	2,170,672.24	0.21
76	002677	浙江美大	150,000	2,089,500.00	0.20
77	300054	鼎龙股份	199,910	2,033,084.70	0.20
78	300065	海兰信	74,973	1,921,557.99	0.19
79	601398	工商银行	352,600	1,851,150.00	0.18
80	601166	兴业银行	89,900	1,515,714.00	0.15
81	002179	中航光电	48,047	1,498,585.93	0.15
82	000651	格力电器	35,700	1,469,769.00	0.14
83	002020	京新药业	118,100	1,399,485.00	0.14
84	000513	丽珠集团	18,900	1,287,090.00	0.13
85	600498	烽火通信	50,500	1,280,175.00	0.13
86	603660	苏州科达	31,100	1,273,545.00	0.12
87	002094	青岛金王	59,600	1,271,268.00	0.12
88	600409	三友化工	122,500	1,233,575.00	0.12
89	601939	建设银行	189,800	1,167,270.00	0.11
90	300124	汇川技术	43,894	1,121,052.76	0.11
91	603986	兆易创新	12,266	954,417.46	0.09
92	002831	裕同科技	12,219	916,425.00	0.09
93	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.08
94	300087	荃银高科	50,000	707,000.00	0.07
95	300518	盛讯达	1,306	147,969.80	0.01
96	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.01
97	603238	诺邦股份	1,750	51,415.00	0.01
98	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
99	603016	新宏泰	1,602	45,817.20	0.00
100	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
101	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
102	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.00
103	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
104	603767	中马传动	1,785	39,751.95	0.00
105	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
106	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
107	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
108	603229	奥翔药业	1,340	26,558.80	0.00
109	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
110	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
111	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
112	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
113	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
114	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
115	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
116	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00

117	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
118	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
119	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
120	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
121	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
122	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	001979	招商蛇口	41,892,350.66	3.64
2	000002	万科 A	32,978,476.75	2.87
3	600201	生物股份	31,180,106.72	2.71
4	002051	中工国际	29,466,280.90	2.56
5	002007	华兰生物	28,472,248.36	2.47
6	000418	小天鹅 A	27,916,171.06	2.43
7	600739	辽宁成大	27,857,830.20	2.42
8	002508	老板电器	26,975,630.61	2.34
9	600109	国金证券	23,657,938.97	2.06
10	600718	东软集团	23,009,781.30	2.00
11	601225	陕西煤业	22,953,193.35	1.99
12	600048	保利地产	22,880,417.47	1.99
13	000065	北方国际	21,767,338.72	1.89
14	600809	山西汾酒	21,650,599.00	1.88
15	000651	格力电器	21,593,489.56	1.88
16	601668	中国建筑	20,746,500.00	1.80
17	002572	索菲亚	20,218,290.88	1.76
18	002179	中航光电	18,860,554.20	1.64
19	601601	中国太保	18,562,470.00	1.61
20	600976	健民集团	18,532,733.36	1.61

7.4.2 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	600963	岳阳林纸	33,585,571.87	2.92
2	600718	东软集团	27,931,190.35	2.43
3	000018	神州长城	25,183,739.17	2.19

4	600109	国金证券	24,164,570.28	2.10
5	601225	陕西煤业	24,133,792.60	2.10
6	000651	格力电器	22,221,740.28	1.93
7	601688	华泰证券	21,128,243.96	1.84
8	002179	中航光电	20,954,288.23	1.82
9	300119	瑞普生物	19,000,694.98	1.65
10	600511	国药股份	18,346,237.88	1.59
11	600498	烽火通信	17,346,711.47	1.51
12	000797	中国武夷	16,739,619.38	1.45
13	600036	招商银行	16,288,764.13	1.42
14	600297	广汇汽车	16,236,567.63	1.41
15	600581	八一钢铁	15,966,080.64	1.39
16	600976	健民集团	15,522,952.60	1.35
17	600835	上海机电	14,456,735.80	1.26
18	600476	湘邮科技	14,411,110.56	1.25
19	002508	老板电器	14,211,665.80	1.23
20	002081	金螳螂	13,421,526.00	1.17

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,369,136,171.98
卖出股票的收入（成交）总额	1,527,589,583.31

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

7.6 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

报告期末，本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属。

7.9 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

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	280,734.41
2	应收证券清算款	4,164,027.83
3	应收股利	-
4	应收利息	17,455.86
5	应收申购款	35,232.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,497,451.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
22,932	45,759.52	19,497,709.82	1.86%	1,029,859,543.03	98.14%

8.2 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

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（新华策略）份额总量的数量区间为 10-50 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 10-50 万份。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 3 月 31 日）基金份额总额	4,069,427,511.95
本报告期期初基金份额总额	1,174,123,608.18
本报告期基金总申购份额	26,157,539.23
减：本报告期基金总赎回份额	150,923,894.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,049,357,252.85

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 2 月 17 日，林艳芳女士离任本基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
民族证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	421,041,389.99	14.56%	392,114.26	16.23%	-
天风证券	1	293,759,404.87	10.16%	214,826.55	8.89%	-
华泰证券	1	274,688,150.36	9.50%	200,878.95	8.32%	-
东方证券	1	274,157,789.52	9.48%	200,491.44	8.30%	-
兴业证券	1	216,653,972.74	7.49%	201,769.41	8.35%	-
平安证券	1	166,697,739.18	5.76%	155,245.48	6.43%	-

光大证券	1	157,697,824.10	5.45%	146,863.59	6.08%	-
信达证券	1	129,410,132.43	4.48%	94,637.66	3.92%	-
中金公司	1	128,333,059.67	4.44%	119,515.62	4.95%	-
国金证券	1	110,228,098.43	3.81%	102,655.27	4.25%	-
恒泰证券	2	85,044,196.53	2.94%	75,420.90	3.12%	-
民生证券	2	83,403,186.15	2.88%	74,021.57	3.06%	-
中信建投	1	78,105,152.33	2.70%	57,117.95	2.36%	-
浙商证券	1	74,370,129.99	2.57%	54,386.76	2.25%	-
国泰君安	1	72,014,243.17	2.49%	67,067.15	2.78%	-
申银万国	1	58,123,119.90	2.01%	54,130.20	2.24%	-
安信证券	1	51,594,608.46	1.78%	37,731.63	1.56%	-
华创证券	1	51,185,688.19	1.77%	37,432.15	1.55%	-
东吴证券	1	48,150,655.12	1.67%	35,212.48	1.46%	-
东兴证券	1	38,982,279.14	1.35%	28,507.10	1.18%	-
川财证券	1	27,867,917.79	0.96%	20,379.90	0.84%	-
中信证券	2	27,517,069.35	0.95%	25,626.61	1.06%	-
招商证券	1	14,450,279.40	0.50%	13,457.62	0.56%	-
渤海证券	1	8,316,652.55	0.29%	6,081.98	0.25%	-

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，本基金报告期内共租用 34 个交易席位，其中报告期内新增 2 个交易席位。新增席位为：东吴证券深圳交易所席位、天风证券深圳交易所席位。

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纪商的排名。

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

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.7.2 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
民族证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	17,700,000.00	15.04%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	100,000,000.00	84.96%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华策略精选股票型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-01-20
2	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回及最低持有份额的数额限制的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-02-15
3	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-02-18
4	新华基金管理股份有限公司关于调整凯石财富代销的部分开放式基金定投金额下限的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-03-24
5	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-03-30
6	新华策略精选股票型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-03-31
7	新华策略精选股票型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-04-21
8	新华策略精选股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-05-13
9	新华策略精选股票型证券投资基金招募说明书（更新）全文	公司网站	2017-05-13
10	新华策略精选股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-05-18
11	新华基金管理股份有限公司新华策略精选股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-05-24

12	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-05-27
13	新华基金管理股份有限公司新华策略精选股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-05-27
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加广发银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-06-20
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-06-28

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华策略精选股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华策略精选股票型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华策略精选股票型证券投资基金托管协议
- (四) 新华策略精选股票型证券投资基金基金合同
- (五) 新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六) 更新的《新华策略精选股票型证券投资基金招募说明书》
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (九) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (十) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇一七年八月二十九日