

新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金
2018 年年度报告摘要
2018 年 12 月 31 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国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	新华鑫动力灵活配置混合	
基金主代码	002083	
交易代码	002083	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年6月8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	23,764,828.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	002083	002084
报告期末下属分级基金的份额总额	18,409,861.80 份	5,354,966.82 份

2.2 基金产品说明

投资目标	综合运用多种投资策略，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上，力争持续实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	投资策略方面，本基金将以资产配置策略为基础，采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
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	qiyan@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 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	新华鑫动力 灵活配置混 合 A	新华鑫动力 灵活配置混 合 C	新华鑫动力 灵活配置混 合 A	新华鑫动力 灵活配置混 合 C	新华鑫动力灵 活配置混合 A	新华鑫动力 灵活配置混 合 C
本期已 实现收 益	-5,770,574. 97	-1,568,875. 58	1,134,818.58	257,908.60	416,246.62	60,088.97
本期利 润	-5,890,339. 29	-1,590,287. 88	1,139,042.08	278,273.13	414,945.20	61,390.39
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.3025	-0.2966	0.0239	0.0199	0.0033	0.0005

本期加权平均净值利润率	-34.99%	-34.51%	2.38%	1.99%	0.33%	0.05%
本期基金份额净值增长率	-30.98%	-31.14%	0.10%	0.10%	0.30%	0.10%
3.1.2 期末	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
数据和指标	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C
期末可供分配基金份额利润	-0.3074	-0.3097	0.0041	0.0016	0.0029	0.0014
期末基金资产净值	12,750,052.13	3,696,552.74	23,305,213.01	6,866,409.19	78,854,351.11	27,127,956.13
期末基金份额净值	0.693	0.690	1.004	1.002	1.003	1.001

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

1. 新华鑫动力灵活配置混合 A:

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	-4.68%	0.84%	-2.66%	0.66%	-2.02%	0.18%
过去三个月	-9.88%	1.14%	-6.41%	0.97%	-3.47%	0.17%
过去六个月	-20.53%	1.06%	-7.37%	0.89%	-13.16%	0.17%
过去一年	-30.98%	1.17%	-13.54%	0.79%	-17.44%	0.38%
自基金合同生效起至今	-30.70%	0.89%	-2.15%	0.60%	-28.55%	0.29%

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中国债券总指数，复合业绩比较标准为 60%×沪深 300 指数+40%×中国债券总指数。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

2. 新华鑫动力灵活配置混合 C:

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	-4.83%	0.86%	-2.66%	0.66%	-2.17%	0.20%
过去三个月	-10.04%	1.14%	-6.41%	0.97%	-3.63%	0.17%
过去六个月	-20.69%	1.07%	-7.37%	0.89%	-13.32%	0.18%
过去一年	-31.14%	1.16%	-13.54%	0.79%	-17.60%	0.37%
自基金合同生效起至今	-31.00%	0.89%	-2.15%	0.60%	-28.85%	0.29%

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

新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来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

(2016 年 6 月 8 日至 2018 年 12 月 31 日)

1、新华鑫动力灵活配置混合 A



注：报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

2、新华鑫动力灵活配置混合 C



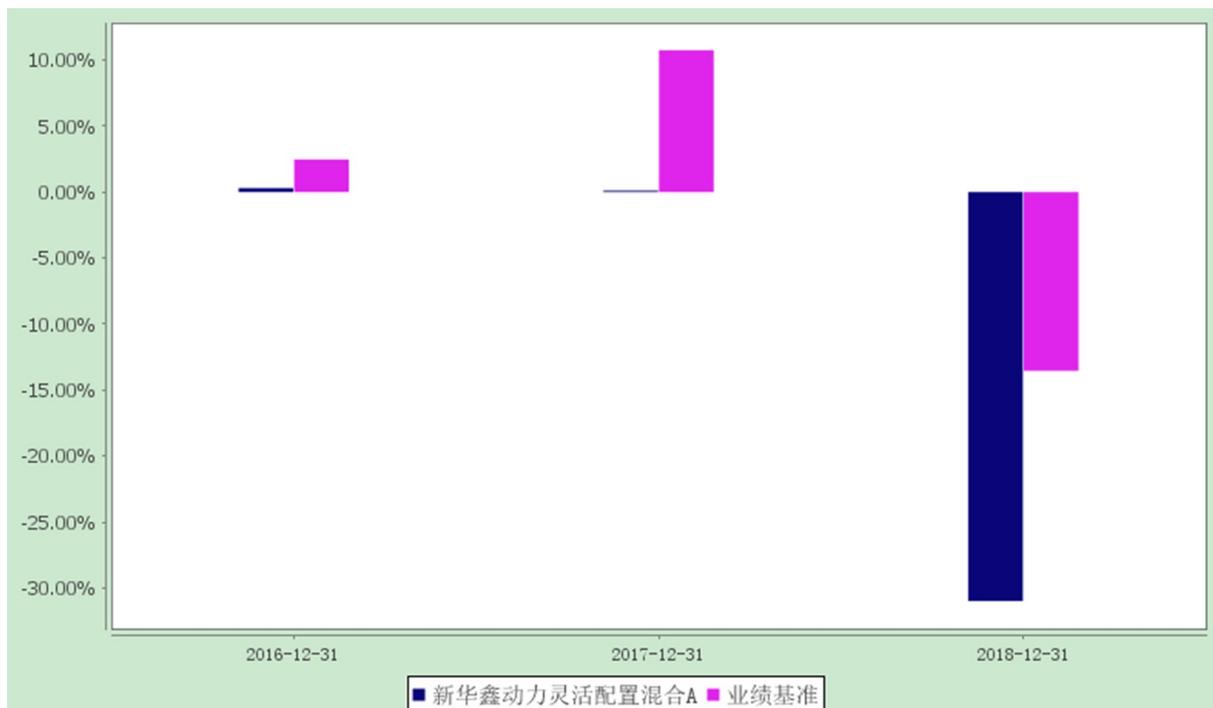
注：报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

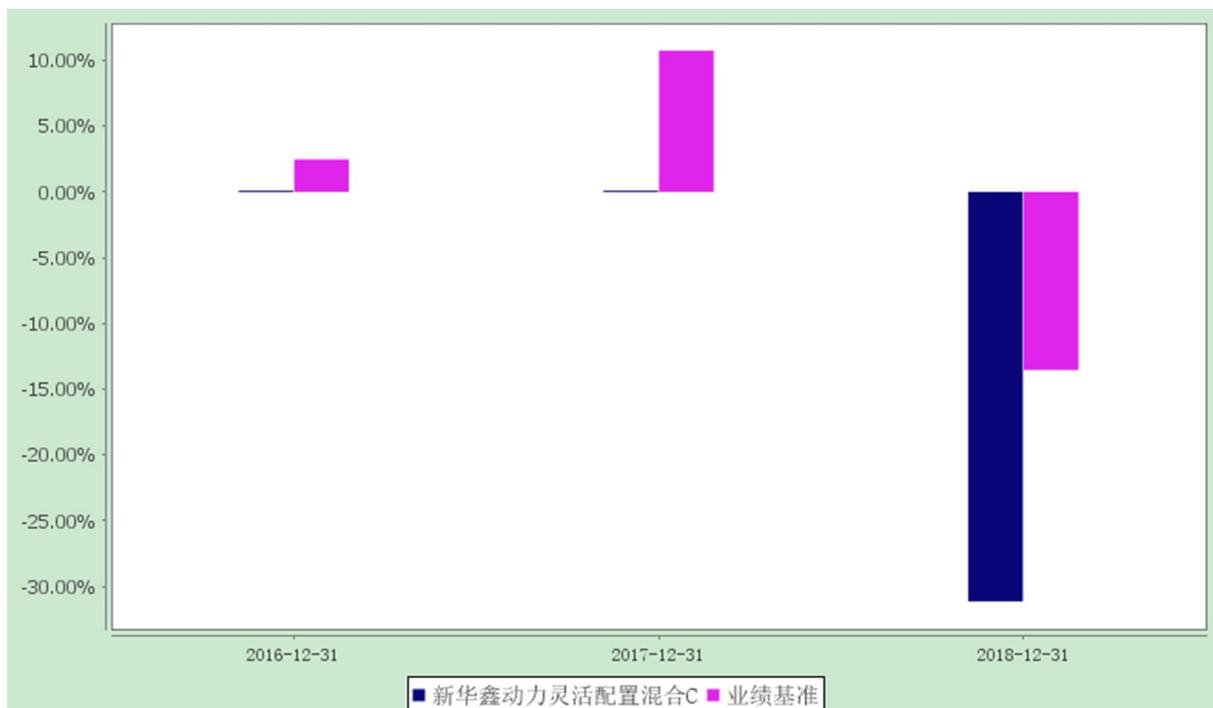
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、新华鑫动力灵活配置混合 A



注：本基金于 2016 年 6 月 8 日基金合同生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

2、新华鑫动力灵活配置混合 C



注：本基金于 2016 年 6 月 8 日基金合同生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2016 年 06 月 08 日基金合同生效，至 2018 年 12 月 31 日未进行过利润分配。

§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		
李会忠	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫锐混合型证券投资基金基金经理。	2016-06-08	-	11	经济学硕士，历任新华基金管理股份有限公司行业研究员、策略分析师、基金经理助理。
王永明	本基金基金经理。	2017-02-17	-	20	经济学博士，历任西南证券资产管理部研究员、恒泰证券研发中心经理、上海名禹资产管理有限公司研究总监、上海尚阳投资管理有限公司投资总监。

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鑫动力灵活配置混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以

及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

场外交易中，对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易，交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议，由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易部向银行间市场或交易所对手询价、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间连续 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，在宏观去杠杆和中美贸易摩擦的双重压力下，呈现出持续下跌的弱势格局。在市场持续阴跌的同时，成交不断萎缩，人气极为低迷。本基金在市场走弱后，进行了一定的减仓避险，但由于市场系统性风险的影响，净值出现了一定的回撤。事实再次证明了自上而下顺应趋势的重要性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金成立于 2016 年 6 月 8 日，截至 2018 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 0.693 元，本报告期份额净值增长率为-30.98%，同期比较基准的增长率为-13.54%；本基金 C 类份额净值为 0.690 元，本报告期份额净值增长率为-31.14%，同期比较基准的增长率为-13.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对 2019 年的 A 股市场，我们持较为乐观的态度。一方面，去产能、去杠杆和去库存的工作取得了较为明显的成绩，供给侧改革的主要目标有望转向补短板 and 降成本。在经济下滑压力下，“就业优先”被摆在更为重要的位置，国内宏观政策将以对冲下滑风险为主，货币和财政政策都较 2018 年边际宽松。另一方面，全球经济的下行风险，促使美联储等各国央行采取更为宽松的取向，能够在一定程度上缓解我国货币政策的压力。经过一年来的反复沟通、协商，中美贸易战有缓解的迹象。对资本市场“牵一发而动全身”的认识和定位，科技立国、转型升级的迫切需要，都使得资本市场面临近年来难得的政策机遇。而经过了 2018 年的大幅下跌，市场估值处于历史低位，系统性风险得到一定程度的释放，为 2019 年的系统性的和结构性的机会打下基础。本基金将顺应时代潮流和市场趋势，以自上而下的策略配置为重，辅以自下而上的投资标的的优选，重点选择科技创新、大金融、优质消费等领域的优质标的，为基金持有人创造良好的回报。

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

本报告期本基金从 2018 年 3 月 13 日至 2018 年 12 月 28 日连续 198 个工作日基金资产净值低于五千万。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 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】01360042 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：新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	6,433,286.90	3,575,797.63
结算备付金	230,897.24	473,156.14
存出保证金	57,484.80	190,786.04
交易性金融资产	4,379,243.00	23,371,317.24
其中：股票投资	4,379,243.00	23,371,317.24
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	-	3,000,000.00
应收证券清算款	6,108,202.30	555,394.72
应收利息	654.85	7,101.60

应收股利	-	-
应收申购款	99.01	1,989.10
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	17,209,868.10	31,175,542.47
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	127,992.50
应付管理人报酬	21,629.10	39,008.87
应付托管费	3,604.86	6,501.48
应付销售服务费	322.62	582.15
应付交易费用	277,706.27	369,834.89
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	460,000.38	460,000.38
负债合计	763,263.23	1,003,920.27
所有者权益:	-	-
实收基金	23,764,828.62	30,065,824.88
未分配利润	-7,318,223.75	105,797.32
所有者权益合计	16,446,604.87	30,171,622.20
负债和所有者权益总计	17,209,868.10	31,175,542.47

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值(A 类)0.693 元，基金份额总额（A 类）18,409,861.80 份；基金份额净值(C 类)0.690 元，基金份额总额（C 类）5,354,966.82 份。

7.2 利润表

会计主体：新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-5,797,176.50	4,787,402.07
1.利息收入	67,337.36	557,577.98
其中：存款利息收入	57,970.36	222,239.90
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	9,367.00	335,338.08
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-5,726,500.77	4,197,514.53
其中：股票投资收益	-5,897,552.93	3,922,755.02
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	171,052.16	274,759.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-141,176.62	24,588.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,163.53	7,721.53
减：二、费用	1,683,450.67	3,370,086.86

1. 管理人报酬	321,726.51	937,580.66
2. 托管费	53,621.14	156,263.44
3. 销售服务费	4,606.68	14,195.68
4. 交易费用	818,755.13	1,766,675.17
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	484,741.21	495,371.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-7,480,627.17	1,417,315.21
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-7,480,627.17	1,417,315.21

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	30,065,824.88	105,797.32	30,171,622.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,480,627.17	-7,480,627.17
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）	-6,300,996.26	56,606.10	-6,244,390.16
其中：1.基金申购款	1,211,171.34	-98,946.70	1,112,224.64
2.基金赎回款	-7,512,167.60	155,552.80	-7,356,614.80

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）	23,764,828.62	-7,318,223.75	16,446,604.87
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	105,717,092.35	265,214.89	105,982,307.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,417,315.21	1,417,315.21
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）	-75,651,267.47	-1,576,732.78	-77,228,000.25
其中：1.基金申购款	2,551,544.11	87,431.22	2,638,975.33
2.基金赎回款	-78,202,811.58	-1,664,164.00	-79,866,975.58
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）	30,065,824.88	105,797.32	30,171,622.20

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

新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2104 号文核准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2016 年 5 月 3 日至 2016 年 6 月 3 日向社会公开募集,设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计 619,212,900.64 份,有效认购户数为 6474 户,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2016]01360032 号验资报告予以验证。2016 年 6 月 8 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,存续期不设定,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《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等、现金及到期日在一年以内的政府债券,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0-95%,中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%,权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准:沪深 300 指数收益率*60%+中国债券总指数收益率*40%。

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 41 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》、《新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期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
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	46,232,473.09	8.02%	76,744,054.84	6.09%

7.4.8.1.2 权证交易

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

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	-	-	18,000,000.00	1.26%

注：本基金本报告期末未持有债券回购交易。

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	40,799.97	8.63%	7,454.47	2.68%
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	66,904.45	6.46%	11,314.25	3.06%

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	321,726.51	937,580.66
其中：支付销售机构的客户维护费	159,825.59	467,429.64

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提确认。计算公式为：每日基金管理费=前一日基金资产净值×（1.5%÷当年天数）

2、本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	53,621.14	156,263.44

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C	合计
合计	-	-	-
获得销售服务费的各 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		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华鑫动力灵活配置混合A	新华鑫动力灵活配置混合C	合计
中国农业银行	-	14,080.47	14,080.47
新华基金管理股份有 限公司	-	32.80	32.80
合计	-	14,113.27	14,113.27

注：基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10% 的年费率逐日计提确认。

其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.10%/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

本报告期末与关联方进行银行间市场交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 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	
	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	6,433,286.90	52,317.34	3,575,797.63

注：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

本基金在本报告期内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

本基金本报告期内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 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至报告期期末本基金未持有流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至报告期期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末未持有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

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

§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	4,379,243.00	25.45
	其中：股票	4,379,243.00	25.45
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	6,664,184.14	38.72
7	其他各项资产	6,166,440.96	35.83
8	合计	17,209,868.10	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	130,900.00	0.80
B	采矿业	372,000.00	2.26
C	制造业	1,613,143.00	9.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	210,600.00	1.28
E	建筑业	411,700.00	2.50
F	批发和零售业	-	-
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	789,300.00	4.80
J	金融业	-	-
K	房地产业	644,200.00	3.92
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	207,400.00	1.26
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	4,379,243.00	26.63

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	300659	中孚信息	30,000	593,700.00	3.61
2	600340	华夏幸福	16,000	407,200.00	2.48
3	601992	金隅集团	100,000	350,000.00	2.13
4	600170	上海建工	100,000	303,000.00	1.84
5	002594	比亚迪	5,000	255,000.00	1.55
6	000401	冀东水泥	20,000	247,600.00	1.51
7	000966	长源电力	60,000	210,600.00	1.28
8	300003	乐普医疗	10,000	208,100.00	1.27
9	300284	苏交科	20,000	207,400.00	1.26
10	601899	紫金矿业	60,000	200,400.00	1.22

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	9,772,768.98	32.39
2	300601	康泰生物	6,597,039.65	21.87
3	600760	中航沈飞	6,398,038.52	21.21
4	000002	万科 A	6,348,716.00	21.04
5	600702	舍得酒业	4,560,164.00	15.11
6	600585	海螺水泥	4,261,854.11	14.13
7	000661	长春高新	4,230,030.00	14.02
8	601318	中国平安	3,887,631.59	12.89
9	601398	工商银行	3,752,600.00	12.44
10	000717	韶钢松山	3,605,727.00	11.95

11	600893	航发动力	3,597,094.00	11.92
12	600036	招商银行	3,528,028.00	11.69
13	601166	兴业银行	3,504,970.00	11.62
14	300373	扬杰科技	3,494,064.00	11.58
15	600809	山西汾酒	3,384,629.00	11.22
16	000001	平安银行	3,378,954.00	11.20
17	600383	金地集团	3,251,509.00	10.78
18	002727	一心堂	3,077,807.34	10.20
19	601009	南京银行	2,969,710.00	9.84
20	600887	伊利股份	2,957,835.00	9.80
21	001979	招商蛇口	2,777,326.00	9.21
22	600845	宝信软件	2,726,949.00	9.04
23	603690	至纯科技	2,708,102.00	8.98
24	600028	中国石化	2,674,100.00	8.86
25	300284	苏交科	2,646,541.00	8.77
26	002382	蓝帆医疗	2,637,770.80	8.74
27	000063	中兴通讯	2,589,708.00	8.58
28	000672	上峰水泥	2,552,542.00	8.46
29	000671	阳光城	2,507,478.00	8.31
30	300122	智飞生物	2,500,648.20	8.29
31	000786	北新建材	2,427,705.85	8.05
32	600859	王府井	2,415,489.00	8.01
33	600837	海通证券	2,402,853.00	7.96
34	600019	宝钢股份	2,352,562.00	7.80
35	002419	天虹股份	2,179,745.00	7.22
36	603019	中科曙光	2,063,520.00	6.84
37	000333	美的集团	2,033,094.00	6.74
38	600801	华新水泥	2,011,770.64	6.67
39	601336	新华保险	2,008,576.00	6.66
40	600879	航天电子	1,982,933.00	6.57
41	300659	中孚信息	1,946,797.68	6.45
42	600000	浦发银行	1,916,854.00	6.35
43	002550	千红制药	1,880,725.00	6.23
44	600519	贵州茅台	1,841,945.00	6.10
45	300326	凯利泰	1,793,247.00	5.94
46	000932	华菱钢铁	1,739,234.00	5.76
47	600690	青岛海尔	1,729,947.72	5.73
48	002129	中环股份	1,685,121.00	5.59
49	002271	东方雨虹	1,669,450.00	5.53
50	002146	荣盛发展	1,657,632.00	5.49
51	601998	中信银行	1,647,100.00	5.46
52	002680	*ST 长生	1,638,996.00	5.43
53	600029	南方航空	1,635,343.00	5.42
54	601111	中国国航	1,626,900.00	5.39

55	300662	科锐国际	1,576,939.00	5.23
56	300347	泰格医药	1,547,917.00	5.13
57	000768	中航飞机	1,530,224.00	5.07
58	600570	恒生电子	1,515,232.00	5.02
59	000858	五粮液	1,494,179.00	4.95
60	002594	比亚迪	1,465,450.00	4.86
61	600507	方大特钢	1,438,032.00	4.77
62	000513	丽珠集团	1,425,460.25	4.72
63	000963	华东医药	1,372,259.00	4.55
64	600068	葛洲坝	1,334,400.00	4.42
65	002508	老板电器	1,310,536.00	4.34
66	603883	老百姓	1,298,849.00	4.30
67	002475	立讯精密	1,288,104.00	4.27
68	002876	三利谱	1,279,000.00	4.24
69	601939	建设银行	1,273,500.00	4.22
70	600720	祁连山	1,271,777.00	4.22
71	601636	旗滨集团	1,269,190.00	4.21
72	600170	上海建工	1,266,000.00	4.20
73	300324	旋极信息	1,241,493.00	4.11
74	600197	伊力特	1,238,037.00	4.10
75	601377	兴业证券	1,190,700.00	3.95
76	601555	东吴证券	1,166,457.00	3.87
77	002035	华帝股份	1,160,820.00	3.85
78	603127	昭衍新药	1,135,111.00	3.76
79	002773	康弘药业	1,108,348.00	3.67
80	300558	贝达药业	1,105,881.00	3.67
81	600346	恒力股份	1,084,485.00	3.59
82	600808	马钢股份	1,083,000.00	3.59
83	601601	中国太保	1,081,594.00	3.58
84	002470	金正大	1,042,349.00	3.45
85	002110	三钢闽光	1,040,591.00	3.45
86	000338	潍柴动力	1,032,000.00	3.42
87	000825	太钢不锈	1,024,000.00	3.39
88	300607	拓斯达	1,017,475.00	3.37
89	600559	老白干酒	1,015,016.00	3.36
90	603986	兆易创新	993,280.00	3.29
91	000581	威孚高科	987,160.00	3.27
92	600867	通化东宝	971,502.00	3.22
93	300383	光环新网	960,700.00	3.18
94	002343	慈文传媒	960,198.00	3.18
95	002007	华兰生物	928,296.00	3.08
96	000728	国元证券	928,100.00	3.08
97	002027	分众传媒	919,600.00	3.05
98	601699	潞安环能	911,945.00	3.02

99	600258	首旅酒店	909,955.00	3.02
100	600388	龙净环保	906,400.00	3.00
101	601800	中国交建	868,600.00	2.88
102	000402	金融街	856,700.00	2.84
103	002859	洁美科技	801,376.00	2.66
104	000839	中信国安	800,000.00	2.65
105	002156	通富微电	795,571.00	2.64
106	601688	华泰证券	788,729.00	2.61
107	300164	通源石油	787,788.00	2.61
108	002236	大华股份	781,463.00	2.59
109	300037	新宙邦	779,151.00	2.58
110	002493	荣盛石化	778,073.00	2.58
111	600282	南钢股份	772,500.00	2.56
112	002045	国光电器	771,230.00	2.56
113	300414	中光防雷	769,843.00	2.55
114	300426	唐德影视	762,991.00	2.53
115	600569	安阳钢铁	747,000.00	2.48
116	600201	生物股份	732,661.00	2.43
117	600038	中直股份	719,007.00	2.38
118	000703	恒逸石化	710,707.90	2.36
119	600188	兖州煤业	699,443.00	2.32
120	300170	汉得信息	698,612.00	2.32
121	601992	金隅集团	697,600.00	2.31
122	000725	京东方 A	696,600.00	2.31
123	000960	锡业股份	696,253.00	2.31
124	600233	圆通速递	689,020.00	2.28
125	600482	中国动力	688,090.00	2.28
126	002438	江苏神通	680,237.00	2.25
127	600990	四创电子	668,424.34	2.22
128	002456	欧菲科技	653,100.00	2.16
129	300365	恒华科技	652,268.00	2.16
130	300523	辰安科技	637,023.00	2.11
131	601788	光大证券	634,496.00	2.10
132	002815	崇达技术	628,706.00	2.08
133	600581	八一钢铁	626,144.00	2.08
134	600196	复星医药	624,790.00	2.07
135	300024	机器人	616,650.00	2.04
136	002019	亿帆医药	613,340.00	2.03
137	600566	济川药业	613,255.00	2.03
138	600525	长园集团	608,871.00	2.02

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利地产	10,800,546.99	35.80
2	600760	中航沈飞	7,584,209.78	25.14
3	000002	万 科 A	7,370,516.02	24.43
4	300601	康泰生物	7,129,405.62	23.63
5	600702	舍得酒业	4,736,692.79	15.70
6	600585	海螺水泥	4,211,055.00	13.96
7	000786	北新建材	4,103,506.87	13.60
8	000661	长春高新	4,086,154.67	13.54
9	000717	韶钢松山	3,911,997.06	12.97
10	601318	中国平安	3,759,259.54	12.46
11	601398	工商银行	3,514,200.00	11.65
12	601166	兴业银行	3,503,208.00	11.61
13	600893	航发动力	3,464,491.00	11.48
14	600036	招商银行	3,445,488.00	11.42
15	600809	山西汾酒	3,440,836.00	11.40
16	300373	扬杰科技	3,380,121.64	11.20
17	603690	至纯科技	3,283,262.00	10.88
18	000001	平安银行	3,269,617.00	10.84
19	000063	中兴通讯	3,198,000.00	10.60
20	600519	贵州茅台	3,162,747.51	10.48
21	002727	一心堂	2,990,764.00	9.91
22	601009	南京银行	2,881,420.90	9.55
23	600887	伊利股份	2,802,092.50	9.29
24	600383	金地集团	2,778,755.26	9.21
25	600507	方大特钢	2,725,362.00	9.03
26	001979	招商蛇口	2,724,943.16	9.03
27	600845	宝信软件	2,662,838.94	8.83
28	600028	中国石化	2,660,812.00	8.82
29	002382	蓝帆医疗	2,614,778.00	8.67
30	300122	智飞生物	2,609,157.96	8.65
31	000672	上峰水泥	2,512,702.50	8.33
32	600837	海通证券	2,431,660.82	8.06
33	300284	苏交科	2,372,303.20	7.86
34	000671	阳 光 城	2,351,420.00	7.79
35	002271	东方雨虹	2,344,348.60	7.77
36	600019	宝钢股份	2,318,313.00	7.68
37	600029	南方航空	2,247,793.22	7.45
38	600859	王府井	2,169,209.00	7.19

39	002508	老板电器	2,127,467.00	7.05
40	002419	天虹股份	2,114,643.20	7.01
41	600801	华新水泥	2,073,495.00	6.87
42	603019	中科曙光	2,034,120.60	6.74
43	000333	美的集团	1,925,024.83	6.38
44	600879	航天电子	1,904,108.00	6.31
45	002146	荣盛发展	1,868,487.04	6.19
46	601336	新华保险	1,862,297.00	6.17
47	600000	浦发银行	1,835,465.00	6.08
48	600990	四创电子	1,832,585.08	6.07
49	300326	凯利泰	1,820,419.00	6.03
50	601636	旗滨集团	1,738,913.00	5.76
51	002550	千红制药	1,735,395.73	5.75
52	600690	青岛海尔	1,718,531.80	5.70
53	000932	华菱钢铁	1,655,768.98	5.49
54	601998	中信银行	1,653,600.00	5.48
55	300347	泰格医药	1,627,543.00	5.39
56	300662	科锐国际	1,617,859.72	5.36
57	002680	*ST 长生	1,607,351.00	5.33
58	000858	五粮液	1,575,964.00	5.22
59	002045	国光电器	1,525,253.00	5.06
60	601111	中国国航	1,519,500.00	5.04
61	002129	中环股份	1,493,800.00	4.95
62	000963	华东医药	1,478,998.28	4.90
63	000768	中航飞机	1,471,391.00	4.88
64	002371	北方华创	1,440,801.68	4.78
65	000513	丽珠集团	1,437,846.00	4.77
66	600570	恒生电子	1,397,021.00	4.63
67	002594	比亚迪	1,345,651.44	4.46
68	603883	老百姓	1,342,224.00	4.45
69	002475	立讯精密	1,330,308.00	4.41
70	601952	苏垦农发	1,308,121.60	4.34
71	600720	祁连山	1,273,968.00	4.22
72	600068	葛洲坝	1,272,271.00	4.22
73	300324	旋极信息	1,254,997.92	4.16
74	601939	建设银行	1,253,400.00	4.15
75	601555	东吴证券	1,235,742.00	4.10
76	002493	荣盛石化	1,228,832.00	4.07
77	300659	中孚信息	1,218,338.60	4.04
78	601908	京运通	1,206,536.00	4.00
79	600197	伊力特	1,176,567.80	3.90
80	002035	华帝股份	1,164,930.00	3.86
81	002773	康弘药业	1,164,000.00	3.86
82	603127	昭衍新药	1,159,180.00	3.84

83	601377	兴业证券	1,133,200.00	3.76
84	300558	贝达药业	1,132,015.00	3.75
85	002876	三利谱	1,127,508.00	3.74
86	600808	马钢股份	1,074,000.00	3.56
87	002470	金正大	1,046,710.00	3.47
88	300661	圣邦股份	1,016,896.06	3.37
89	000825	太钢不锈	1,014,000.00	3.36
90	600559	老白干酒	1,013,250.40	3.36
91	600346	恒力股份	1,008,272.00	3.34
92	601601	中国太保	1,001,693.86	3.32
93	000581	威孚高科	1,000,398.14	3.32
94	002110	三钢闽光	989,496.80	3.28
95	300607	拓斯达	965,302.00	3.20
96	300383	光环新网	963,423.00	3.19
97	600170	上海建工	944,000.00	3.13
98	603986	兆易创新	939,236.00	3.11
99	002007	华兰生物	927,918.00	3.08
100	600867	通化东宝	923,698.00	3.06
101	000402	金融街	916,825.00	3.04
102	000728	国元证券	903,022.00	2.99
103	000338	潍柴动力	898,800.00	2.98
104	601800	中国交建	877,795.00	2.91
105	601699	潞安环能	840,000.00	2.78
106	002027	分众传媒	839,500.00	2.78
107	002343	慈文传媒	828,602.00	2.75
108	002645	华宏科技	822,600.00	2.73
109	002156	通富微电	814,650.00	2.70
110	601688	华泰证券	809,297.00	2.68
111	600258	首旅酒店	808,816.00	2.68
112	002859	洁美科技	800,129.00	2.65
113	300523	辰安科技	788,080.00	2.61
114	300164	通源石油	786,882.00	2.61
115	600282	南钢股份	784,504.00	2.60
116	600388	龙净环保	765,789.00	2.54
117	000761	本钢板材	755,830.00	2.51
118	002236	大华股份	750,583.00	2.49
119	600201	生物股份	750,266.00	2.49
120	000839	中信国安	744,000.00	2.47
121	300426	唐德影视	735,758.00	2.44
122	600038	中直股份	729,053.30	2.42
123	000960	锡业股份	722,000.00	2.39
124	300037	新宙邦	718,700.00	2.38
125	300414	中光防雷	717,049.00	2.38
126	600569	安阳钢铁	715,800.00	2.37

127	601788	光大证券	702,600.00	2.33
128	600536	中国软件	696,246.18	2.31
129	000725	京东方 A	694,800.00	2.30
130	002438	江苏神通	671,296.00	2.22
131	000703	恒逸石化	656,235.81	2.18
132	300365	恒华科技	641,730.00	2.13
133	600196	复星医药	640,483.00	2.12
134	002372	伟星新材	639,000.00	2.12
135	002019	亿帆医药	635,400.00	2.11
136	600233	圆通速递	615,300.00	2.04
137	002815	崇达技术	613,200.00	2.03

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	281,901,864.27
卖出股票的收入（成交）总额	294,855,208.96

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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

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**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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之外的股票。

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	57,484.80
2	应收证券清算款	6,108,202.30
3	应收股利	-
4	应收利息	654.85
5	应收申购款	99.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	6,166,440.96
---	----	--------------

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中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

份额级别	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
新华鑫动力灵活配置混合 A	654	28,149.64	0.00	0.00%	18,409,861.80	100.00%
新华鑫动力灵活配置混合 C	195	27,461.37	99,244.35	1.85%	5,255,722.47	98.15%
合计	849	27,991.55	99,244.35	0.42%	23,665,584.27	99.58%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	新华鑫动力灵活配置混合 A	0.00	0.00%
	新华鑫动力灵活配置混	0.00	0.00%

	合 C		
	合计	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	份额级别	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	新华鑫动力灵活配置混合 A	0
	新华鑫动力灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华鑫动力灵活配置混合 A	0
	新华鑫动力灵活配置混合 C	0
	合计	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

项目	新华鑫动力灵活配置混合 A	新华鑫动力灵活配置混合 C
基金合同生效日（2016 年 6 月 8 日）基金份额总额	206,788,092.88	412,424,807.76
本报告期期初基金份额总额	23,210,280.59	6,855,544.29
本报告期基金总申购份额	484,846.64	726,324.70
减：本报告期基金总赎回份额	5,285,265.43	2,226,902.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,409,861.80	5,354,966.82

§11 重大事件揭示

11.1 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。

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

本报告期末未有涉及基金管理人、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 2016 年至 2018 年，瑞华会计师事务所为本基金连续提供 3 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	
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	50,195,616.12	8.70%	36,708.10	7.77%	-
浙商证券	1	47,383,480.41	8.22%	34,651.57	7.33%	-
中金公司	1	41,202,859.90	7.14%	38,372.28	8.12%	-

天风证券	1	40,057,086.37	6.95%	29,293.82	6.20%	-
东兴证券	1	39,427,383.25	6.84%	28,833.17	6.10%	-
齐鲁证券	1	39,249,805.60	6.81%	36,553.30	7.73%	-
恒泰证券	1	34,951,145.53	6.06%	32,549.88	6.89%	-
华泰证券	1	34,747,286.95	6.02%	25,410.11	5.38%	-
兴业证券	1	30,168,222.45	5.23%	28,095.73	5.94%	-
国泰君安	1	23,069,648.49	4.00%	21,484.69	4.54%	-
国金证券	1	21,587,266.63	3.74%	20,103.99	4.25%	-
光大证券	1	18,995,840.72	3.29%	17,690.82	3.74%	-
中信证券	1	17,125,276.00	2.97%	15,948.70	3.37%	-
信达证券	1	16,343,419.87	2.83%	11,952.08	2.53%	-
中信建投	1	14,377,764.96	2.49%	10,514.58	2.22%	-
东方证券	1	13,172,337.60	2.28%	9,632.85	2.04%	-
川财证券	1	12,408,304.30	2.15%	9,074.35	1.92%	-
恒泰证券	1	11,281,327.56	1.96%	8,250.03	1.75%	-
银河证券	1	9,654,788.08	1.67%	7,060.60	1.49%	-
华创证券	1	9,339,041.00	1.62%	6,829.69	1.44%	-
安信证券	1	8,255,822.00	1.43%	6,037.56	1.28%	-
招商证券	1	8,170,576.04	1.42%	7,609.34	1.61%	-
平安证券	1	7,965,308.40	1.38%	7,418.16	1.57%	-
民生证券	1	7,626,245.00	1.32%	5,577.05	1.18%	-
申银万国	1	6,986,847.00	1.21%	6,506.92	1.38%	-
中信证券	1	4,326,731.00	0.75%	4,029.46	0.85%	-
渤海证券	1	3,563,812.00	0.62%	2,606.26	0.55%	-
国盛证券	1	3,403,797.00	0.59%	2,489.15	0.53%	-
新时代证券	1	697,106.00	0.12%	649.22	0.14%	-
国盛证券	1	547,142.00	0.09%	400.12	0.08%	-
新时代证券	1	259,285.00	0.04%	241.48	0.05%	-
华创证券	1	216,500.00	0.04%	158.32	0.03%	-

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。

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
国泰君安	-	-	500,000.00	8.20%	-	-
安信证券	-	-	1,600,000.00	26.23%	-	-
国盛证券	-	-	4,000,000.00	65.57%	-	-

注：回购交易不包含非担保交收金额。

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

新华基金管理股份有限公司

二〇一九年三月二十八日