

**新华鑫益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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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	新华鑫益灵活配置混合
基金主代码	000584
交易代码	000584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 16 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	210,354,230.89 份
基金合同存续期	不定期

## 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，力争为投资人提供长期稳定的绝对回报。
投资策略	投资策略的选择，本基金将兼顾下行风险控制和收益获取。在资产配置策略方面，主要采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在股票投资策略方面，把握趋势跟随及绝对收益两个核心，趋势跟随策略以期在某行业或个股出现趋势性机会时，积极跟随其市场表现；绝对收益策略以类套利策略为目标，以期获取稳定的绝对回报。在债券投资策略方面，本基金将综合运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略、中小企业私募债券投资策略及可转换债券投资策略，在获取稳定收益的同时，降低基金资产净值整体的波动性。
业绩比较基准	年化收益率 10%
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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	李帅帅
	联系电话	010-68779688	0755-25878287
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		4008198866	95511-3
传真		010-68779528	0755-82080387

### 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	-18,214,395.56	29,095,012.38	-19,478,905.70
本期利润	-22,460,960.95	27,069,900.55	-48,540,170.51
加权平均基金份额本期利润	-0.1358	0.2267	-0.1814
本期基金份额净值增长率	-6.43%	14.54%	-5.47%
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	-0.0141	0.0841	-0.1833
期末基金资产净值	386,065,142.98	257,134,103.60	241,556,772.95
期末基金份额净值	1.835	1.961	1.712

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)。

4、本基金于 2014 年 04 月 16 日基金合同生效。

### 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 3 月	-4.53%	0.90%	2.52%	0.00%	-7.05%	0.90%
过去 6 月	-6.23%	0.81%	5.04%	0.00%	-11.27%	0.81%
过去 1 年	-6.43%	0.95%	10.00%	0.00%	-16.43%	0.95%
过去 3 年	1.33%	0.94%	30.03%	0.00%	-28.70%	0.94%
自基金合同生效至今	83.50%	1.27%	47.15%	0.00%	36.35%	1.27%

注：1、本基金的业绩比较基准采用年化收益率 10%。

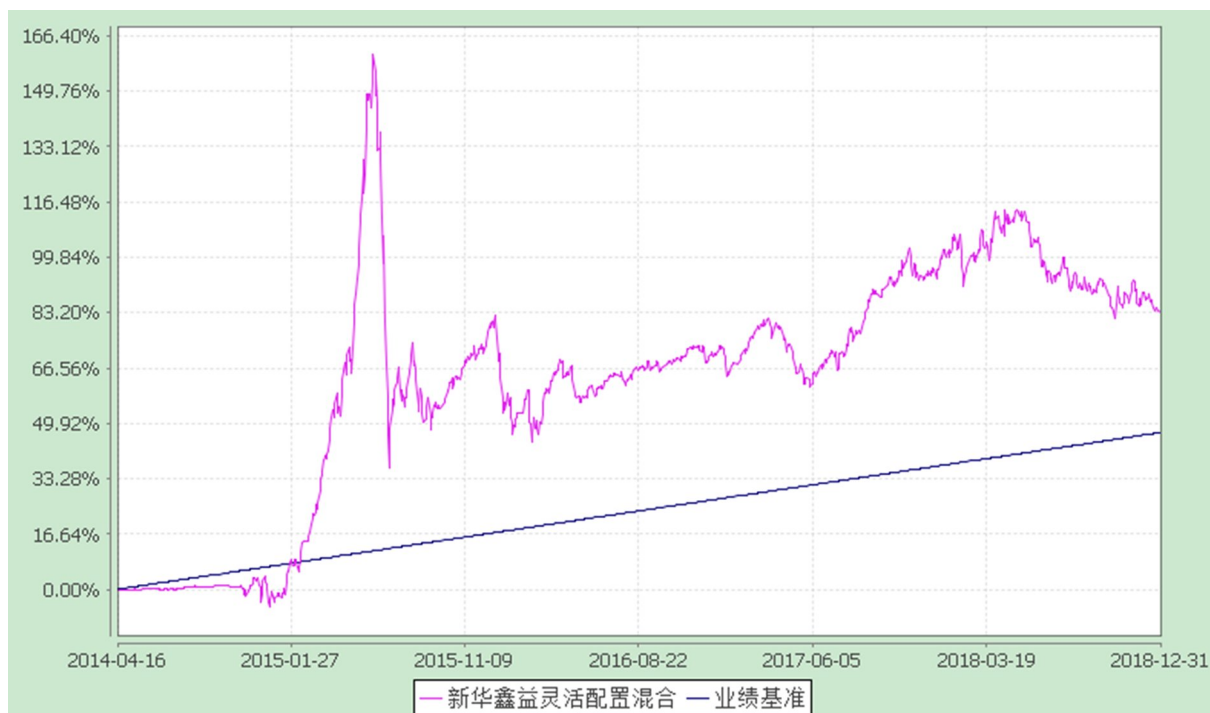
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

#### 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

新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014 年 4 月 16 日至 2018 年 12 月 31 日)

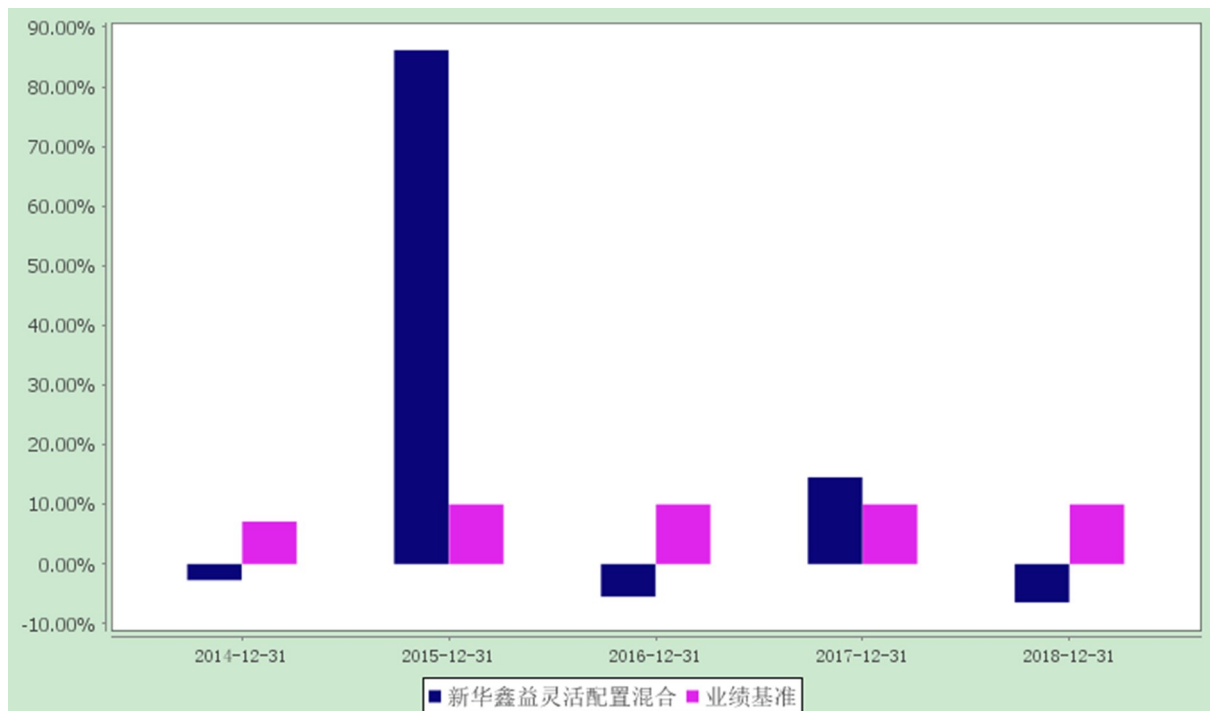


注：本基金自 2014 年 4 月 16 日基金合同生效。

### 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

新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2014 年 4 月 16 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

过去三年本基金未进行过利润分配。

## §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		
崔建波	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监、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、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基	2014-12-01	-	23	经济学硕士，历任天津中融证券投资咨询公司研究员、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。



	金经理、新华华荣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、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。				
栾超	本基金基金经理，新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理。	2017-07-18	-	6	经济学硕士，历任中邮创业基金管理股份有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华鑫益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》、《新华鑫益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。

基金管理人对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，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 1.835 元，本报告期份额净值增长率为-6.43%，同期比较基准的增长率为 10.00%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

##### 4.7.1.1 估值工作小组的职责分工

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

估值工作小组职责：

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

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

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

##### 4.7.1.2 基金会计的职责分工

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

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；

- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

#### 4.7.1.3 投资管理部的职责分工

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

#### 4.7.1.4 交易部的职责分工

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

#### 4.7.1.5 监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

## §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

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 张伟 胡慰 签字出具了瑞华审字【2019】01360012 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：新华鑫益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	201,205,072.98	83,308,374.38

结算备付金	3,362,382.38	1,977,304.11
存出保证金	986,832.32	548,526.06
交易性金融资产	110,277,467.37	140,153,423.49
其中：股票投资	110,277,467.37	140,153,423.49
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	69,800,344.70	30,000,000.00
应收证券清算款	2,786,747.37	4,436,342.64
应收利息	79,850.32	73,705.29
应收股利	-	-
应收申购款	48,935.00	37,520.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>388,547,632.44</b>	<b>260,535,195.97</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
负 债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	30,670.41	766,041.86
应付管理人报酬	497,230.05	280,908.41
应付托管费	82,871.69	46,818.06
应付销售服务费	165,743.36	93,636.14

应付交易费用	1,245,973.95	1,753,687.90
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	460,000.00	460,000.00
<b>负债合计</b>	<b>2,482,489.46</b>	<b>3,401,092.37</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	210,354,230.89	131,091,630.31
未分配利润	175,710,912.09	126,042,473.29
<b>所有者权益合计</b>	<b>386,065,142.98</b>	<b>257,134,103.60</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>388,547,632.44</b>	<b>260,535,195.97</b>

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.835 元，基金份额总额 210,354,230.89 份。

## 7.2 利润表

会计主体：新华鑫益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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-4,682,099.78</b>	<b>37,096,483.42</b>
1.利息收入	1,420,536.45	731,938.49
其中：存款利息收入	997,576.03	509,046.78
债券利息收入	-	1,976.62
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	422,960.42	220,915.09
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,875,066.36	38,368,091.87
其中：股票投资收益	-3,668,830.11	36,969,460.37

基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	115,899.19
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	1,793,763.75	1,282,732.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,246,565.39	-2,025,111.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	18,995.52	21,564.89
<b>减：二、费用</b>	<b>17,778,861.17</b>	<b>10,026,582.87</b>
1. 管理人报酬	4,866,773.16	3,194,739.02
2. 托管费	811,128.91	532,456.62
3. 销售服务费	1,622,257.82	1,064,912.89
4. 交易费用	10,017,201.28	4,774,474.34
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	461,500.00	460,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-22,460,960.95</b>	<b>27,069,900.55</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-22,460,960.95</b>	<b>27,069,900.55</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华鑫益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）	131,091,630.31	126,042,473.29	257,134,103.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-22,460,960.95	-22,460,960.95
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）	79,262,600.58	72,129,399.75	151,392,000.33
其中：1.基金申购款	173,119,088.57	167,695,960.75	340,815,049.32
2.基金赎回款	-93,856,487.99	-95,566,561.00	-189,423,048.99
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）	210,354,230.89	175,710,912.09	386,065,142.98
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）	141,128,802.54	100,427,970.41	241,556,772.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,069,900.55	27,069,900.55
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）	-10,037,172.23	-1,455,397.67	-11,492,569.90
其中：1.基金申购款	91,225,037.00	73,381,153.50	164,606,190.50

2.基金赎回款	-101,262,209.23	-74,836,551.17	-176,098,760.40
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）	131,091,630.31	126,042,473.29	257,134,103.60

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

新华鑫益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[2014]243 号文件《关于核准新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2014 年 3 月 14 日至 4 月 14 日向社会公开募集,首次募集资金总额 211,129,655.08 元,其中募集资金产生利息 21,845.69 元,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2014]37100014 号验资报告予以验证。2014 年 4 月 16 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,基金托管人为平安银行股份有限公司。2014 年 12 月 12 日,基金管理人经与基金托管人协商一致,将本基金名称由“新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金”变更为“新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金”。

根据《新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫益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、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%,持有单只中小企业私募

债券市值不超过基金资产净值的 10%，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%。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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》、《新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金合同》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
平安银行股份有限公司	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
北京新华富时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金托管人股东

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 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	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管理费	4,866,773.16	3,194,739.02
其中：支付销售机构的客户维护费	771,777.76	871,773.33

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)

#### 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	811,128.91	532,456.62

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
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
平安银行股份有限公司	0.00
恒泰证券股份有限公司	0.00
新华基金管理股份有限公司	451,681.76
合计	451,681.76

注：本基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.5%/当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间未进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	201,205,072.98	921,409.95	83,308,374.38	480,692.91

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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

本报告期及上年度可比期间本基金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

本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

### 7.4.9.1 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	限售股	13.77	10.97	257,791.00	3,549,782.07	2,827,967.27	-
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 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.2.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期内未发生银行间市场债券正回购。

##### 7.4.9.2.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	110,277,467.37	28.38
	其中：股票	110,277,467.37	28.38
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	69,800,344.70	17.96
	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	204,567,455.36	52.65
7	其他各项资产	3,902,365.01	1.00
8	合计	388,547,632.44	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	34,028,303.63	8.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,831,380.00	0.47
F	批发和零售业	12,509,652.50	3.24
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	48,927,485.44	12.67
J	金融业	50,145.80	0.01
K	房地产业	9,280,500.00	2.40
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,650,000.00	0.95
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	110,277,467.37	28.56

### 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	879,920	17,413,616.80	4.51
2	600861	北京城乡	1,799,950	12,509,652.50	3.24
3	300550	和仁科技	230,923	12,072,654.44	3.13
4	002129	中环股份	1,200,018	8,676,130.14	2.25
5	603019	中科曙光	230,000	8,252,400.00	2.14
6	000063	中兴通讯	400,000	7,836,000.00	2.03
7	603636	南威软件	699,999	6,719,990.40	1.74
8	002912	中新赛克	75,000	6,079,500.00	1.57
9	300253	卫宁健康	450,000	5,607,000.00	1.45
10	600048	保利地产	450,000	5,305,500.00	1.37

### 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	603019	中科曙光	86,155,607.86	33.51
2	002281	光迅科技	77,001,453.36	29.95
3	000768	中航飞机	67,197,668.50	26.13
4	601336	新华保险	59,758,730.02	23.24
5	601939	建设银行	57,114,622.86	22.21
6	600048	保利地产	55,129,847.97	21.44

7	600029	南方航空	50,419,536.12	19.61
8	601398	工商银行	45,498,878.44	17.69
9	300567	精测电子	44,758,363.43	17.41
10	002129	中环股份	42,018,240.88	16.34
11	000671	阳光城	39,377,182.80	15.31
12	000977	浪潮信息	36,172,359.09	14.07
13	000063	中兴通讯	35,788,882.32	13.92
14	601111	中国国航	35,462,635.79	13.79
15	600585	海螺水泥	34,950,777.56	13.59
16	600183	生益科技	34,610,590.82	13.46
17	000932	华菱钢铁	34,470,057.50	13.41
18	000066	中国长城	33,651,337.53	13.09
19	001979	招商蛇口	32,980,553.14	12.83
20	601225	陕西煤业	31,269,070.22	12.16
21	300659	中孚信息	31,114,063.72	12.10
22	600808	马钢股份	30,293,025.76	11.78
23	601998	中信银行	29,330,323.73	11.41
24	002916	深南电路	28,765,228.10	11.19
25	601117	中国化学	28,570,177.94	11.11
26	600028	中国石化	27,995,317.70	10.89
27	300450	先导智能	26,620,863.08	10.35
28	600038	中直股份	26,395,528.03	10.27
29	600690	青岛海尔	26,385,295.53	10.26
30	600030	中信证券	26,200,027.00	10.19
31	601601	中国太保	25,732,640.07	10.01
32	000401	冀东水泥	24,657,176.01	9.59
33	600760	中航沈飞	23,864,951.00	9.28
34	600893	航发动力	23,384,738.80	9.09
35	002672	东江环保	23,164,664.00	9.01
36	300188	美亚柏科	22,836,355.25	8.88
37	000672	上峰水泥	22,812,766.88	8.87
38	601818	光大银行	22,657,000.00	8.81
39	600498	烽火通信	22,618,907.14	8.80
40	600519	贵州茅台	21,415,230.30	8.33
41	300212	易华录	21,057,492.05	8.19
42	600703	三安光电	20,927,451.54	8.14
43	601699	潞安环能	20,799,927.00	8.09
44	600887	伊利股份	19,861,053.85	7.72
45	600019	宝钢股份	19,347,189.15	7.52
46	002456	欧菲科技	19,155,397.04	7.45
47	300170	汉得信息	18,934,906.54	7.36
48	002271	东方雨虹	18,902,756.25	7.35
49	600125	铁龙物流	18,745,758.00	7.29
50	600036	招商银行	18,428,518.00	7.17

51	300601	康泰生物	18,168,584.07	7.07
52	300016	北陆药业	17,838,490.00	6.94
53	600271	航天信息	17,461,446.87	6.79
54	002405	四维图新	16,878,905.81	6.56
55	000651	格力电器	16,774,724.00	6.52
56	000807	云铝股份	16,383,564.00	6.37
57	300383	光环新网	16,110,334.00	6.27
58	600196	复星医药	16,038,700.13	6.24
59	600050	中国联通	15,960,837.00	6.21
60	601600	中国铝业	15,839,344.37	6.16
61	600588	用友网络	15,780,279.24	6.14
62	601688	华泰证券	15,752,643.00	6.13
63	601992	金隅集团	15,702,503.40	6.11
64	000333	美的集团	15,605,084.97	6.07
65	600801	华新水泥	14,463,499.03	5.62
66	000733	振华科技	14,391,731.15	5.60
67	000661	长春高新	14,330,595.46	5.57
68	600584	长电科技	14,314,970.90	5.57
69	002202	金风科技	14,313,496.26	5.57
70	601636	旗滨集团	14,307,255.00	5.56
71	600809	山西汾酒	14,254,067.00	5.54
72	300613	富瀚微	14,225,563.50	5.53
73	002920	德赛西威	14,209,340.79	5.53
74	000002	万 科 A	14,142,058.51	5.50
75	600188	兖州煤业	13,807,761.87	5.37
76	300037	新宙邦	13,706,670.00	5.33
77	600606	绿地控股	13,679,151.00	5.32
78	600600	青岛啤酒	13,604,745.02	5.29
79	002338	奥普光电	13,578,608.00	5.28
80	603929	亚翔集成	13,552,249.83	5.27
81	002698	博实股份	13,513,665.57	5.26
82	600282	南钢股份	13,439,295.00	5.23
83	600803	新奥股份	13,261,083.13	5.16
84	600967	内蒙一机	13,154,460.18	5.12
85	600702	舍得酒业	12,962,846.00	5.04
86	300699	光威复材	12,930,704.84	5.03
87	002146	荣盛发展	12,683,487.10	4.93
88	600068	葛洲坝	12,622,738.70	4.91
89	002439	启明星辰	12,622,372.14	4.91
90	600861	北京城乡	12,401,995.90	4.82
91	300315	掌趣科技	11,961,822.60	4.65
92	000022	深赤湾 A	11,874,296.80	4.62
93	002470	金正大	11,762,526.00	4.57
94	000402	金 融 街	11,620,346.00	4.52

95	600720	祁连山	11,583,897.00	4.51
96	300502	新易盛	11,560,819.00	4.50
97	300113	顺网科技	11,549,880.24	4.49
98	601800	中国交建	11,470,815.00	4.46
99	000039	中集集团	11,420,092.89	4.44
100	300671	富满电子	11,397,026.24	4.43
101	600845	宝信软件	11,248,187.26	4.37
102	300550	和仁科技	11,247,670.60	4.37
103	002372	伟星新材	11,210,233.16	4.36
104	600779	水井坊	11,111,606.00	4.32
105	000786	北新建材	10,940,477.71	4.25
106	603659	璞泰来	10,783,365.00	4.19
107	300253	卫宁健康	10,778,878.84	4.19
108	002065	东华软件	10,637,440.84	4.14
109	300623	捷捷微电	10,627,032.30	4.13
110	002912	中新赛克	10,586,279.91	4.12
111	000789	万年青	10,582,594.63	4.12
112	600754	锦江股份	10,534,214.79	4.10
113	600582	天地科技	10,512,096.80	4.09
114	300251	光线传媒	10,501,686.00	4.08
115	300559	佳发教育	10,360,230.30	4.03
116	600258	首旅酒店	10,243,527.00	3.98
117	002821	凯莱英	10,134,320.00	3.94
118	000998	隆平高科	10,121,554.75	3.94
119	300166	东方国信	10,091,551.00	3.92
120	000858	五粮液	9,945,290.00	3.87
121	002007	华兰生物	9,849,446.00	3.83
122	002078	太阳纸业	9,830,714.00	3.82
123	000910	大亚圣象	9,762,632.00	3.80
124	300607	拓斯达	9,761,991.00	3.80
125	601877	正泰电器	9,700,275.00	3.77
126	300687	赛意信息	9,615,585.20	3.74
127	300609	汇纳科技	9,574,489.00	3.72
128	601233	桐昆股份	9,559,368.80	3.72
129	002661	克明面业	9,440,776.58	3.67
130	002675	东诚药业	9,440,399.00	3.67
131	300302	同有科技	9,408,614.93	3.66
132	002308	威创股份	9,361,756.00	3.64
133	600567	山鹰纸业	9,341,543.00	3.63
134	601288	农业银行	9,124,000.00	3.55
135	000547	航天发展	9,107,647.00	3.54
136	002353	杰瑞股份	9,107,564.08	3.54
137	000606	顺利办	9,035,720.94	3.51
138	002905	金逸影视	9,026,414.00	3.51

139	002410	广联达	9,014,218.94	3.51
140	002876	三利谱	8,961,219.52	3.49
141	002027	分众传媒	8,921,254.82	3.47
142	000961	中南建设	8,794,927.00	3.42
143	600343	航天动力	8,683,200.00	3.38
144	601138	工业富联	8,620,901.28	3.35
145	601390	中国中铁	8,616,055.00	3.35
146	300414	中光防雷	8,605,512.00	3.35
147	601857	中国石油	8,562,354.00	3.33
148	002233	塔牌集团	8,511,562.00	3.31
149	002659	凯文教育	8,503,179.00	3.31
150	600782	新钢股份	8,453,223.00	3.29
151	000799	酒鬼酒	8,419,399.00	3.27
152	002156	通富微电	8,398,181.00	3.27
153	600547	山东黄金	8,294,723.98	3.23
154	000898	鞍钢股份	8,279,672.44	3.22
155	600340	华夏幸福	8,247,925.00	3.21
156	603589	口子窖	8,232,819.38	3.20
157	300308	中际旭创	8,211,204.56	3.19
158	600562	国睿科技	8,195,346.10	3.19
159	603357	设计总院	8,195,318.21	3.19
160	601666	平煤股份	8,045,343.96	3.13
161	600970	中材国际	7,942,424.57	3.09
162	000983	西山煤电	7,917,597.80	3.08
163	600073	上海梅林	7,748,166.06	3.01
164	600884	杉杉股份	7,729,426.00	3.01
165	600885	宏发股份	7,637,080.40	2.97
166	300373	扬杰科技	7,619,787.04	2.96
167	300747	锐科激光	7,618,697.48	2.96
168	300348	长亮科技	7,583,368.00	2.95
169	000933	神火股份	7,564,349.70	2.94
170	002559	亚威股份	7,561,660.00	2.94
171	300122	智飞生物	7,544,583.00	2.93
172	600718	东软集团	7,458,626.60	2.90
173	600879	航天电子	7,274,837.62	2.83
174	002786	银宝山新	6,990,136.53	2.72
175	002773	康弘药业	6,931,838.94	2.70
176	600438	通威股份	6,909,532.00	2.69
177	600495	晋西车轴	6,909,220.80	2.69
178	000546	金圆股份	6,905,861.00	2.69
179	300199	翰宇药业	6,847,473.79	2.66
180	603636	南威软件	6,791,754.60	2.64
181	002544	杰赛科技	6,714,974.33	2.61
182	000513	丽珠集团	6,641,268.22	2.58

183	000797	中国武夷	6,636,916.01	2.58
184	600623	华谊集团	6,599,976.00	2.57
185	002465	海格通信	6,579,736.03	2.56
186	601328	交通银行	6,504,161.00	2.53
187	300017	网宿科技	6,470,256.86	2.52
188	600326	西藏天路	6,415,580.33	2.50
189	002341	新纶科技	6,412,136.89	2.49
190	603808	歌力思	6,334,703.20	2.46
191	300036	超图软件	6,317,837.31	2.46
192	000014	沙河股份	6,292,407.00	2.45
193	002268	卫士通	6,281,010.00	2.44
194	300624	万兴科技	6,254,806.00	2.43
195	600360	华微电子	6,160,958.00	2.40
196	300474	景嘉微	6,121,205.00	2.38
197	000971	高升控股	6,112,663.00	2.38
198	002463	沪电股份	6,074,818.52	2.36
199	002079	苏州固锟	6,062,007.00	2.36
200	601088	中国神华	6,018,474.00	2.34
201	000839	中信国安	5,946,487.00	2.31
202	300287	飞利信	5,827,102.00	2.27
203	002677	浙江美大	5,823,609.00	2.26
204	300347	泰格医药	5,819,950.83	2.26
205	300024	机器人	5,749,567.00	2.24
206	600643	爱建集团	5,731,575.75	2.23
207	600115	东方航空	5,673,567.00	2.21
208	600691	阳煤化工	5,652,306.00	2.20
209	300648	星云股份	5,603,354.00	2.18
210	600990	四创电子	5,498,813.00	2.14
211	603297	永新光学	5,424,786.32	2.11
212	603826	坤彩科技	5,376,968.82	2.09
213	600335	国机汽车	5,376,151.63	2.09
214	300070	碧水源	5,338,528.00	2.08
215	601333	广深铁路	5,333,654.00	2.07
216	600827	百联股份	5,329,011.50	2.07
217	002224	三力士	5,301,566.00	2.06
218	600529	山东药玻	5,300,663.01	2.06
219	600563	法拉电子	5,265,545.65	2.05
220	300097	智云股份	5,224,935.96	2.03
221	300454	深信服	5,508,106.28	2.14

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	002281	光迅科技	78,413,711.06	30.50
2	603019	中科曙光	78,366,395.23	30.48
3	000768	中航飞机	68,885,910.72	26.79
4	601336	新华保险	60,465,401.29	23.52
5	600029	南方航空	58,118,324.73	22.60
6	601939	建设银行	58,059,249.45	22.58
7	300567	精测电子	53,076,242.57	20.64
8	601398	工商银行	53,051,760.75	20.63
9	600048	保利地产	52,606,476.39	20.46
10	000977	浪潮信息	37,617,312.98	14.63
11	000932	华菱钢铁	37,548,999.99	14.60
12	000671	阳光城	37,359,579.93	14.53
13	601111	中国国航	37,097,619.56	14.43
14	002129	中环股份	35,293,775.32	13.73
15	600183	生益科技	34,433,520.51	13.39
16	600585	海螺水泥	33,946,676.83	13.20
17	000066	中国长城	33,716,693.93	13.11
18	001979	招商蛇口	32,985,690.67	12.83
19	601998	中信银行	31,626,867.56	12.30
20	601225	陕西煤业	30,157,496.00	11.73
21	600808	马钢股份	30,156,753.38	11.73
22	002916	深南电路	29,371,453.72	11.42
23	600028	中国石化	28,342,373.60	11.02
24	601117	中国化学	27,729,808.30	10.78
25	000063	中兴通讯	27,429,532.19	10.67
26	600038	中直股份	27,307,309.83	10.62
27	600030	中信证券	26,845,893.28	10.44
28	300450	先导智能	26,514,406.36	10.31
29	600690	青岛海尔	26,511,474.05	10.31
30	601601	中国太保	26,027,699.05	10.12
31	000401	冀东水泥	25,406,607.16	9.88
32	600893	航发动力	24,295,542.00	9.45
33	600498	烽火通信	23,721,792.87	9.23
34	600760	中航沈飞	23,556,446.55	9.16
35	300188	美亚柏科	22,907,723.35	8.91
36	600519	贵州茅台	22,719,397.11	8.84
37	601818	光大银行	22,437,005.58	8.73
38	002672	东江环保	22,251,313.92	8.65



39	601699	潞安环能	21,420,619.20	8.33
40	300212	易华录	21,206,177.27	8.25
41	000672	上峰水泥	21,136,253.00	8.22
42	600703	三安光电	20,170,592.74	7.84
43	600887	伊利股份	19,880,542.52	7.73
44	002456	欧菲科技	19,255,317.05	7.49
45	600036	招商银行	18,995,882.34	7.39
46	600019	宝钢股份	18,801,695.50	7.31
47	600271	航天信息	18,795,313.55	7.31
48	600050	中国联通	18,785,176.02	7.31
49	600125	铁龙物流	18,694,526.26	7.27
50	002271	东方雨虹	18,385,157.02	7.15
51	002405	四维图新	17,557,767.15	6.83
52	300601	康泰生物	17,542,990.84	6.82
53	300170	汉得信息	17,463,465.00	6.79
54	000651	格力电器	16,937,783.00	6.59
55	300016	北陆药业	16,346,515.07	6.36
56	601600	中国铝业	16,098,613.99	6.26
57	600588	用友网络	16,074,156.52	6.25
58	600196	复星医药	16,011,599.90	6.23
59	601992	金隅集团	15,914,027.00	6.19
60	600584	长电科技	15,667,266.08	6.09
61	600801	华新水泥	15,661,373.84	6.09
62	601688	华泰证券	15,448,186.00	6.01
63	000807	云铝股份	15,423,181.78	6.00
64	002338	奥普光电	15,219,446.96	5.92
65	600809	山西汾酒	15,138,627.30	5.89
66	000661	长春高新	14,966,678.83	5.82
67	300383	光环新网	14,917,750.18	5.80
68	002920	德赛西威	14,490,210.17	5.64
69	000733	振华科技	14,399,482.00	5.60
70	002202	金风科技	14,379,438.66	5.59
71	600702	舍得酒业	14,156,337.00	5.51
72	000333	美的集团	14,058,901.00	5.47
73	600282	南钢股份	13,970,410.00	5.43
74	600188	兖州煤业	13,940,863.93	5.42
75	300559	佳发教育	13,923,847.00	5.42
76	300613	富瀚微	13,757,843.00	5.35
77	002439	启明星辰	13,721,006.75	5.34
78	300659	中孚信息	13,522,360.80	5.26
79	600362	江西铜业	13,359,310.84	5.20
80	600803	新奥股份	13,280,037.25	5.16
81	601636	旗滨集团	13,174,136.93	5.12
82	300037	新宙邦	13,018,887.49	5.06

83	000002	万 科 A	12,994,927.00	5.05
84	000786	北新建材	12,870,657.53	5.01
85	002470	金正大	12,811,290.76	4.98
86	600600	青岛啤酒	12,758,129.85	4.96
87	600718	东软集团	12,685,608.55	4.93
88	600967	内蒙一机	12,514,577.39	4.87
89	300699	光威复材	12,419,434.00	4.83
90	002698	博实股份	12,392,110.98	4.82
91	600779	水井坊	12,226,617.00	4.75
92	603929	亚翔集成	12,209,372.00	4.75
93	600606	绿地控股	12,162,701.00	4.73
94	300315	掌趣科技	12,003,358.03	4.67
95	000022	深赤湾 A	11,998,839.86	4.67
96	000039	中集集团	11,650,483.57	4.53
97	600068	葛洲坝	11,616,157.60	4.52
98	000402	金 融 街	11,476,439.00	4.46
99	002372	伟星新材	11,441,102.08	4.45
100	601800	中国交建	11,179,157.87	4.35
101	300113	顺网科技	11,034,931.96	4.29
102	600845	宝信软件	11,014,479.10	4.28
103	300671	富满电子	10,925,308.80	4.25
104	600754	锦江股份	10,920,847.20	4.25
105	600720	祁连山	10,920,644.51	4.25
106	600258	首旅酒店	10,740,351.01	4.18
107	300623	捷捷微电	10,658,244.00	4.15
108	300502	新易盛	10,634,076.00	4.14
109	000858	五 粮 液	10,622,176.00	4.13
110	603659	璞泰来	10,570,710.04	4.11
111	300302	同有科技	10,545,145.00	4.10
112	002065	东华软件	10,505,579.80	4.09
113	000789	万年青	10,489,510.20	4.08
114	002078	太阳纸业	10,432,950.39	4.06
115	600582	天地科技	10,270,904.15	3.99
116	300251	光线传媒	10,236,734.00	3.98
117	002821	凯莱英	10,191,911.00	3.96
118	002353	杰瑞股份	10,114,023.00	3.93
119	600114	东睦股份	10,005,443.59	3.89
120	600885	宏发股份	9,975,300.20	3.88
121	002007	华兰生物	9,788,335.26	3.81
122	300166	东方国信	9,717,967.97	3.78
123	002905	金逸影视	9,681,752.61	3.77
124	601233	桐昆股份	9,679,810.10	3.76
125	000910	大亚圣象	9,590,775.35	3.73
126	000998	隆平高科	9,371,327.67	3.64

127	002156	通富微电	9,326,709.32	3.63
128	000547	航天发展	9,317,708.00	3.62
129	002661	克明面业	9,271,505.04	3.61
130	600567	山鹰纸业	9,256,305.00	3.60
131	601877	正泰电器	9,227,855.00	3.59
132	300607	拓斯达	9,185,302.00	3.57
133	603197	保隆科技	9,064,639.00	3.53
134	000961	中南建设	9,064,291.52	3.53
135	601288	农业银行	8,829,000.00	3.43
136	300687	赛意信息	8,805,452.60	3.42
137	601857	中国石油	8,770,000.00	3.41
138	002410	广联达	8,736,518.92	3.40
139	601899	紫金矿业	8,704,565.60	3.39
140	601666	平煤股份	8,692,761.34	3.38
141	600547	山东黄金	8,649,126.44	3.36
142	000799	酒鬼酒	8,645,042.00	3.36
143	300122	智飞生物	8,641,874.00	3.36
144	603589	口子窖	8,575,940.45	3.34
145	002675	东诚药业	8,533,588.00	3.32
146	600343	航天动力	8,466,462.00	3.29
147	002308	威创股份	8,464,362.22	3.29
148	002876	三利谱	8,426,961.00	3.28
149	300308	中际旭创	8,415,068.25	3.27
150	002233	塔牌集团	8,407,681.08	3.27
151	000983	西山煤电	8,374,279.88	3.26
152	600782	新钢股份	8,335,592.83	3.24
153	600346	恒力股份	8,305,991.23	3.23
154	300609	汇纳科技	8,232,291.35	3.20
155	000703	恒逸石化	8,179,763.80	3.18
156	002659	凯文教育	8,164,686.60	3.18
157	000898	鞍钢股份	8,146,965.00	3.17
158	000606	顺利办	8,037,771.00	3.13
159	002027	分众传媒	7,958,429.00	3.10
160	300747	锐科激光	7,879,928.00	3.06
161	603357	设计总院	7,874,100.46	3.06
162	600073	上海梅林	7,855,446.86	3.05
163	600340	华夏幸福	7,849,557.13	3.05
164	002146	荣盛发展	7,715,012.00	3.00
165	600562	国睿科技	7,689,736.43	2.99
166	600970	中材国际	7,611,790.00	2.96
167	600884	杉杉股份	7,512,930.00	2.92
168	600879	航天电子	7,452,516.62	2.90
169	300373	扬杰科技	7,332,921.21	2.85
170	000933	神火股份	7,214,886.00	2.81

171	600495	晋西车轴	7,197,202.00	2.80
172	600326	西藏天路	7,185,847.34	2.79
173	300348	长亮科技	6,976,239.00	2.71
174	300199	翰宇药业	6,938,305.64	2.70
175	300648	星云股份	6,901,400.00	2.68
176	002559	亚威股份	6,878,886.00	2.68
177	002465	海格通信	6,818,608.00	2.65
178	002544	杰赛科技	6,772,825.66	2.63
179	000014	沙河股份	6,765,190.00	2.63
180	300624	万兴科技	6,746,970.00	2.62
181	002341	新纶科技	6,698,885.74	2.61
182	002773	康弘药业	6,656,563.00	2.59
183	300036	超图软件	6,632,730.55	2.58
184	600623	华谊集团	6,612,554.00	2.57
185	600438	通威股份	6,610,036.00	2.57
186	601328	交通银行	6,540,000.00	2.54
187	000546	金圆股份	6,479,796.00	2.52
188	300017	网宿科技	6,381,100.08	2.48
189	601390	中国中铁	6,343,623.00	2.47
190	000971	高升控股	6,316,516.36	2.46
191	002786	银宝山新	6,291,136.00	2.45
192	002268	卫士通	6,226,846.84	2.42
193	000513	丽珠集团	6,161,959.70	2.40
194	300347	泰格医药	6,127,631.11	2.38
195	002463	沪电股份	6,018,865.77	2.34
196	601088	中国神华	5,971,160.45	2.32
197	600115	东方航空	5,926,919.10	2.30
198	603297	永新光学	5,893,859.00	2.29
199	002079	苏州固锝	5,885,593.00	2.29
200	603808	歌力思	5,838,268.25	2.27
201	300287	飞利信	5,827,133.00	2.27
202	601668	中国建筑	5,790,032.98	2.25
203	000797	中国武夷	5,789,978.60	2.25
204	002677	浙江美大	5,771,083.00	2.24
205	600990	四创电子	5,753,502.00	2.24
206	300024	机器人	5,658,273.73	2.20
207	300070	碧水源	5,656,628.00	2.20
208	600529	山东药玻	5,656,592.29	2.20
209	300474	景嘉微	5,635,056.00	2.19
210	603826	坤彩科技	5,633,184.50	2.19
211	600360	华微电子	5,617,551.51	2.18
212	600563	法拉电子	5,551,174.00	2.16
213	300655	晶瑞股份	5,544,471.12	2.16
214	000839	中信国安	5,528,576.20	2.15

215	600643	爱建集团	5,499,733.87	2.14
216	300447	全信股份	5,447,810.00	2.12
217	600691	阳煤化工	5,426,440.96	2.11
218	600335	国机汽车	5,411,050.54	2.10
219	601009	南京银行	5,358,114.00	2.08
220	300253	卫宁健康	5,295,068.48	2.06
221	300097	智云股份	5,257,735.00	2.04
222	600827	百联股份	5,241,935.14	2.04
223	603538	美诺华	5,233,994.16	2.04

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	3,781,893,868.00
卖出股票的收入（成交）总额	3,803,854,428.62

注：“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

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同中尚无国债期货的投资政策。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本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的备选股票库。

### 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	986,832.32
2	应收证券清算款	2,786,747.37
3	应收股利	-
4	应收利息	79,850.32
5	应收申购款	48,935.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,902,365.01

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明。

### 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
8,485	24,791.31	141,919,599.57	67.47%	68,434,631.32	32.53%

### 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	721,196.35	0.34%

注：本公司所有从业人员持有本基金份额总量为 721196.35 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 50~100 万份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年4月16日)基金份额总额	211,129,655.08
本报告期期初基金份额总额	131,091,630.31
本报告期基金总申购份额	173,119,088.57
减：本报告期基金总赎回份额	93,856,487.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	210,354,230.89

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2018年5月21日，沈健先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所情况。报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。审计年限为 1 年。自 2014 年至 2018 年，瑞华会计师事务所为本基金连续提供 5 年审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，本基金无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	



	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
光大证券	2	4,045,458,954.35	53.39%	2,958,446.57	53.39%	-
方正证券	2	2,207,739,167.45	29.14%	1,614,511.49	29.14%	-
东方证券	2	1,323,906,551.82	17.47%	968,179.49	17.47%	-

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6个交易席位，其中报告期内新增0个交易席位，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
光大证券	-	-	630,000,000.00	40.38%	-	-
方正证券	-	-	880,000,000.00	56.41%	-	-
东方证券	-	-	50,000,000.00	3.21%	-	-

注：回购交易不包括非担保交收金额。

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份 额	申购份 额	赎回份 额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180603	27,917,364.60	0.00	27,917,364.60	0.00	0.00%
	2	20180903-20180920	0.00	29,527,559.06	0.00	29,527,559.06	14.04%
产品特有风险							
<p>1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

新华基金管理股份有限公司

二〇一九年三月二十八日