

新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年三月二十九日

§ 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。

基金托管人中国工商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。

本报告中财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 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.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	58

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	58
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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12 投资组合报告附注	59
§9 基金份额持有人信息	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§10 开放式基金份额变动	61
§ 11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新沃通盈灵活配置混合
基金主代码	002564
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日
基金管理人	新沃基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	14,744,848.08 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以风险管理为前提，通过把握中国稳增长与促转型的发展现状，灵活运用多种投资策略，挖掘各大类资产配置机会，力求高于业绩比较基准的长期资产增值。
投资策略	本基金在深度把握中国经济发展与转型的基础上，通过自上而下的宏观-中观-微观的资产配置策略，以及自下而上的精选行业、个股的基本面分析策略，再通过定性分析和定量分析相结合的选股方法，辅以多种事件驱动、量化研究等工具策略，在风险管理的前提下因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产长期增值。
业绩比较基准	65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但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		新沃基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘小舫	郭明
	联系电话	400-698-9988	010-66105799
	电子邮箱	service@sinvofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-698-9988	95588
传真		010-58290555	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 2250 号 2 幢二层 C220 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市海淀区丹棱街 3 号	北京市西城区复兴门内大街 55

	中国电子大厦 B 座 1616 室	号
邮政编码	100080	100140
法定代表人	朱灿	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.sinvofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	新沃基金管理有限公司	北京市海淀区丹棱街 3 号中国电子大厦 B 座 1616 室

§ 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 9 月 22 日 (基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,765,801.34	-28,427.82	8,091,830.99
本期利润	-2,046,978.41	-80,396.01	8,091,830.99
加权平均基金份额本期利润	-0.1634	-0.0050	0.0656
本期加权平均净值利润率	-17.60%	-0.47%	5.87%
本期基金份额净值增长率	-15.15%	-2.20%	41.14%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-1,939,483.09	267,392.09	2,235,560.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1315	0.0235	0.0455
期末基金资产净值	12,805,364.99	11,658,521.67	51,323,724.51
期末基金份额净值	0.868	1.023	1.046
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	17.12%	38.03%	41.14%

注：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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

3.2 基金净值表现

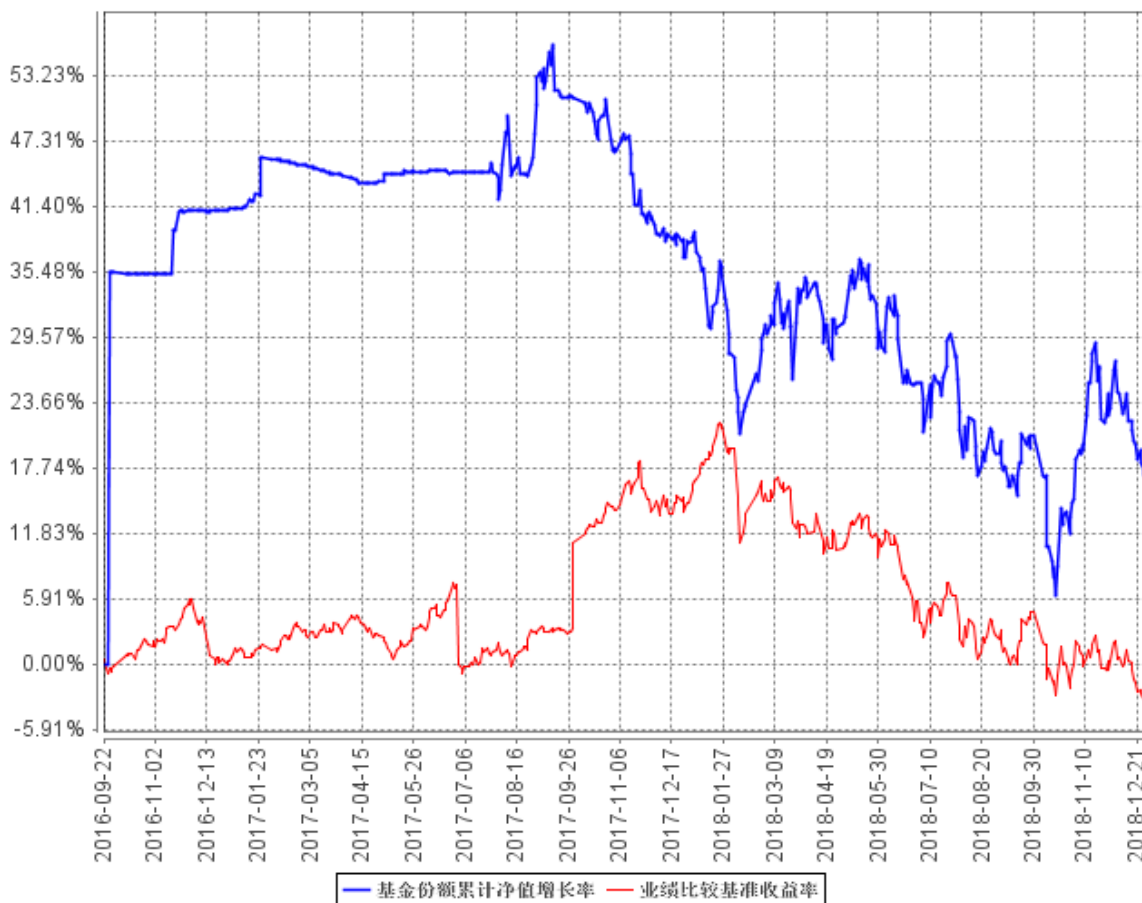
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.91%	1.64%	-7.12%	1.04%	4.21%	0.60%
过去六个月	-6.57%	1.42%	-7.96%	0.96%	1.39%	0.46%
过去一年	-15.15%	1.31%	-15.07%	0.88%	-0.08%	0.43%
自基金合同生效起至今	17.12%	1.77%	-2.70%	0.80%	19.82%	0.97%

注：本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则，本基金选取“65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率”作为本基金的比较基准。

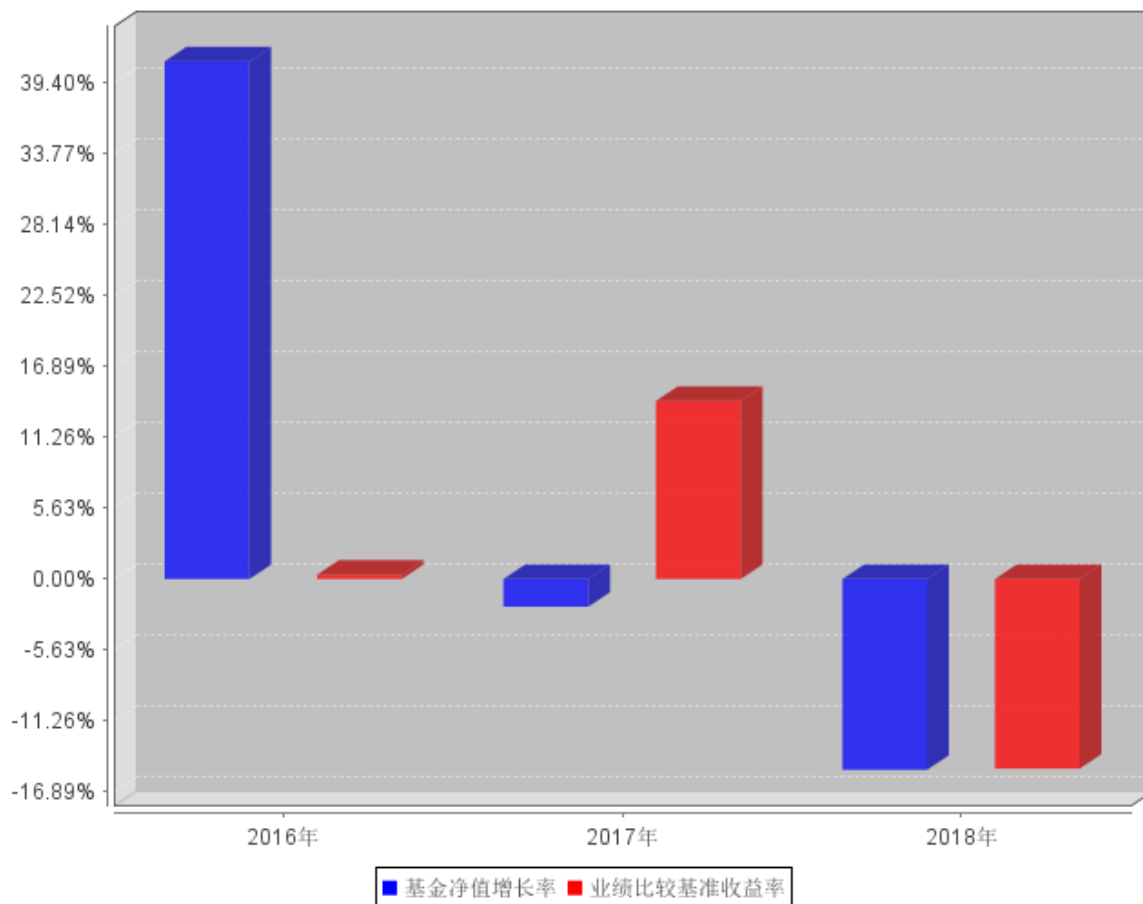
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

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对比图



注：本基金合同于 2016 年 9 月 22 日生效，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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
2016	3.5000	266,860,235.61	44,991.21	266,905,226.82	
合计	3.5000	266,860,235.61	44,991.21	266,905,226.82	

§ 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

新沃基金管理有限公司成立于 2015 年 8 月，是一家经中国证监会核准设立的全国性基金管理公司，注册资本 10,000 万元，具有基金管理资格，经营基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

公司成立以来，公募基金和特定客户资产管理业务均得到较快发展。公司于 2015 年成立了新沃通宝货币市场基金，并于 2016 年成立了新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金、新沃通利纯债债券型证券投资基金和新沃鑫禧债券型证券投资基金，同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

未来，公司将继续秉承“专业创造价值，合作实现价值”的发展理念，坚持“以人为本”的发展战略，坚守“诚信、专业、合作、超越”的价值准则，致力于经过长期努力跻身国内一流基金管理公司行列，力求为广大投资者提供稳定的投资回报。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
俞臻	本基金的基金经理	2018 年 6 月 28 日	-	6 年	复旦大学硕士，中国籍。2013 年 7 月至 2016 年 9 月任职于国金证券，历任证券交易员、投资经理、投资主办；2016 年 10 月加入新沃基金管理有限公司。
邵将	-	2016 年 9 月 22 日	2018 年 6 月 28 日	7 年	物理学硕士，中国籍。2012 年 6 月至 2016 年 6 月任职于天弘基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员，兼任制造行业组组长。2016 年 7 月加入新沃基金管理有限公司。
武亮	-	2017 年 4 月 27 日	2018 年 3 月 8 日	8 年	香港城市大学博士，中国籍。2011 年 8 月至 2012 年 9 月任职于海通证券，担任研究所固定收益研究员；2012 年 10 月至 2016 年 10 月任职

					于平安资产管理有限责任公司，历任债券研究部策略主管、固收资管部投资经理等职务；2016年10月加入新沃基金，任固定收益部总经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《新沃基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

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

本产品在今年合理分散布局各个板块分散风险，并实现反弹后逐渐均衡组合配置，进行了一定的仓位控制和时点选择，一定程度上规避了系统性风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.868 元；本报告期基金份额净值增长率为-15.15%，业绩比较基准收益率为-15.07%。

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，经济下行压力增大，经济数据总体疲弱，行业分化较为严重，以地产投资为主导的经济结构仍有下行的风险，同时中美贸易战一定程度上也增加了市场对未来经济运行的担忧，宏观经济对于价值投资提出了更高的挑战。

市场流动性方面，资金面整体宽松，R007 处于历史相对低位。期间美联储如期加息而我国通过 TMLF 表态我国货币政策的异步性，继续保持整体宽松以支持实体经济。货币政策信号明确并在关键时点保证了足量的流动性。

国际环境方面，中美之间的贸易战在年末暂时告一段落，虽然人民币存在一定压力，但国家保证汇率的稳定的立场依然坚定，未来汇率可能将保持震荡走势。

债券市场环境较好，预期未来仍将维持震荡走势；股市虽有短期情绪性上涨但长期来看依然需要实体经济上涨动能的支持，未来有待对政策和经济进行持续的观察和论证。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内本基金管理人结合法律法规和业务发展的需要，进一步制定完善了公司的内部制度及流程；组织了多项合规及业务培训，提高员工的风险意识和合规意识；针对销售、投资研究等重点业务，加大内部检查力度，促进公司各项业务合法合规稳健经营；对基金的宣传推介、投资交易、运营、IT 等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

本报告期内本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提升监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，为建立健全有效的估值政策和程序，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由投资研究部、监察稽核部、基金事务部相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日

常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

(3) 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

(4) 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 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

报告期内，本基金于 2018 年 3 月 6 日至 2018 年 5 月 9 日期间出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况；本基金于 2018 年 1 月 2 日至 2018 年 12 月 28 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会报告并提出解决方案，本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的管理人——新沃基金管理有限公司在新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新沃基金管理有限公司编制和披露的新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字（2019）第 22328 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了新沃通盈混合基金 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。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于新沃通盈混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	新沃通盈混合基金的基金管理人新沃基金管理有限公司管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估新沃通盈混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算新沃通盈混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督新沃通盈混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗

	<p>漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对新沃通盈混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致新沃通盈混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇 郭蕙心
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新沃通盈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	附注号	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	7.4.7.1	48,359.34	3,320,726.85
结算备付金		255,747.21	109,233.55
存出保证金		16,383.24	39,307.02
交易性金融资产	7.4.7.2	12,534,045.00	8,310,724.00
其中：股票投资		11,801,547.00	7,813,478.00
基金投资		-	-
债券投资		732,498.00	497,246.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		235,800.05	-
应收利息	7.4.7.5	20,569.93	10,282.04
应收股利		-	-
应收申购款		4,680.97	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		13,115,585.74	11,790,273.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		194,681.82	-
应付赎回款		8,798.46	-
应付管理人报酬		6,726.62	5,999.22
应付托管费		1,681.65	1,499.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	31,829.79	55,252.80
应交税费		2.41	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	66,500.00	69,000.00
负债合计		310,220.75	131,751.79
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	14,744,848.08	11,391,129.58
未分配利润	7.4.7.10	-1,939,483.09	267,392.09
所有者权益合计		12,805,364.99	11,658,521.67
负债和所有者权益总计		13,115,585.74	11,790,273.46

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 14,744,848.08 份，基金份额净值 0.868 元。

7.2 利润表

会计主体：新沃通盈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	附注号	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		-1,474,602.81	531,801.49
1. 利息收入		48,189.63	340,496.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,721.62	59,333.86
债券利息收入		24,172.09	29,842.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,295.92	251,320.17
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,244,886.08	-273,453.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,323,431.22	-279,097.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-7,404.00	5,194.30
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	85,949.14	450.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-281,177.07	-51,968.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,270.71	516,726.44
减：二、费用		572,375.60	612,197.50
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	69,666.95	124,424.23
2. 托管费	7.4.10.2.2	17,416.75	26,800.09
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	363,063.16	249,511.85

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3.74	-
7. 其他费用	7.4.7.20	122,225.00	211,461.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,046,978.41	-80,396.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,046,978.41	-80,396.01

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新沃通盈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）	11,391,129.58	267,392.09	11,658,521.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,046,978.41	-2,046,978.41
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）	3,353,718.50	-159,896.77	3,193,821.73
其中：1. 基金申购款	4,546,751.58	-262,869.10	4,283,882.48
2. 基金赎回款	-1,193,033.08	102,972.33	-1,090,060.75
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）	14,744,848.08	-1,939,483.09	12,805,364.99
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	49,088,164.47	2,235,560.04	51,323,724.51

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-80,396.01	-80,396.01
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)	-37,697,034.89	-1,887,771.94	-39,584,806.83
其中: 1. 基金申购款	50,605,330.20	3,240,713.99	53,846,044.19
2. 基金赎回款	-88,302,365.09	-5,128,485.93	-93,430,851.02
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)	11,391,129.58	267,392.09	11,658,521.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

易勇

易勇

马楠

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]394号《关于准予新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由新沃基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币201,825,420.01元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1247号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,825,782.39份基金份额,其中认购资金利息折合362.38份基金份额。本基金的基金管理人为新沃基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃通盈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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券等)、权证、货币市场工具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)。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，持有的权证合计市值占基金资产的比例为 0%-3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值 5%。本基金的业绩比较基准为 $65\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+35\% \times$ 中证全债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人新沃基金管理有限公司于 2019 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新沃通盈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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2018 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债为其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一

定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日

活期存款	48,359.34	3,320,726.85
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	48,359.34	3,320,726.85

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	12,132,817.79	11,801,547.00	-331,270.79
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	734,372.47	732,498.00
	银行间市场	-	-
	合计	734,372.47	732,498.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	12,867,190.26	12,534,045.00	-333,145.26
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,829,509.72	7,813,478.00	-16,031.72
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	29,332.47	28,446.00
	银行间市场	503,850.00	468,800.00
	合计	533,182.47	497,246.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,362,692.19	8,310,724.00	-51,968.19

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	14.99	903.37
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	126.61	54.01
应收债券利息	20,420.19	9,305.19
应收资产支持证券利息	-	-
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	8.14	19.47
合计	20,569.93	10,282.04

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	31,829.79	55,252.80
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	31,829.79	55,252.80

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
----	--------------------	---------------------

预提费用	66,500.00	69,000.00
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
合计	66,500.00	69,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,391,129.58	11,391,129.58
本期申购	4,546,751.58	4,546,751.58
本期赎回（以“-”号填列）	-1,193,033.08	-1,193,033.08
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	14,744,848.08	14,744,848.08

7.4.7.10 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	342,323.92	-74,931.83	267,392.09
本期利润	-1,765,801.34	-281,177.07	-2,046,978.41
本期基金份额交易产生的变动数	-300,285.72	140,388.95	-159,896.77
其中：基金申购款	-407,879.22	145,010.12	-262,869.10
基金赎回款	107,593.50	-4,621.17	102,972.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,723,763.14	-215,719.95	-1,939,483.09

7.4.7.11 存款利息收入

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
	活期存款利息收入	7,711.33

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	2,613.88	12,967.66
其他	396.41	150.22
合计	10,721.62	59,333.86

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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
卖出股票成交总额	187,412,226.51	104,758,220.98
减：卖出股票成本总额	188,735,657.73	105,037,318.32
买卖股票差价收入	-1,323,431.22	-279,097.34

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,404.00	5,194.30
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-7,404.00	5,194.30

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,125,331.50	5,024,053.75
减：卖出债券（、债转股及债券到	1,103,904.00	4,908,099.44

期兑付) 成本总额		
减: 应收利息总额	28,831.50	110,760.01
买卖债券差价收入	-7,404.00	5,194.30

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	85,949.14	450.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	85,949.14	450.00

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-281,177.07	-51,968.19
——股票投资	-315,239.07	-16,031.72
——债券投资	34,062.00	-35,936.47
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-281,177.07	-51,968.19

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	3,270.71	516,726.44
合计	3,270.71	516,726.44

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，对持有期内的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	363,063.16	249,511.85
银行间市场交易费用	-	-
合计	363,063.16	249,511.85

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	55,000.00	60,000.00
信息披露费	30,000.00	62,661.33
其他手续费	1,225.00	10,900.00
银行间账户维护费	36,000.00	37,500.00
律师费用	-	40,000.00
开户费	-	400.00
合计	122,225.00	211,461.33

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新沃基金	基金管理人、注册登记机构和基金销售机构
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
新沃资本控股集团有限公司	基金管理人的股东
新沃联合资产管理有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	69,666.95	124,424.23
其中：支付销售机构的客户维护费	821.28	171.22

注：自2017年1月1日至2017年1月22日，支付基金管理人新沃基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，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×1.50%/当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于调整新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金管理费率及托管费率并修改基金合同的议案》，自2017年1月23日起，支付基金管理人新沃基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，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×0.60%/当年天数。

7.4.10.2.2 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	17,416.75	26,800.09

的托管费		
------	--	--

注：自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 22 日，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于调整新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金管理费率及托管费率并修改基金合同的议案》，自 2017 年 1 月 23 日起，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 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
基金合同生效日（2016 年 9 月 22 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,878,908.13	-
期间申购/买入总份额	-	1,878,908.13
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	1,878,908.13	1,878,908.13
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.74%	16.49%

注：基金管理人新沃基金在本年度申购本基金的交易委托新沃基金直销中心办理，适用申购费率为 0.80%

7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未投资本基金。

7.4.10.5 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 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
中国工商银行	48,359.34	7,711.33	3,320,726.85	46,215.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按适用利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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(股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600030	中信证券	2018年12月25日	因重大资产重组停牌	16.01	2019年1月10日	17.15	8,400	137,931.09	134,484.00	-
000708	大冶特钢	2018年12月25日	因重大资产重组停牌	8.77	2019年1月3日	9.65	11,200	102,720.00	98,224.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金以风险管理为前提，通过把握中国稳增长与促转型的发展现状，灵活运用多种投资策略，挖掘各大类资产配置机会，力求高于业绩比较基准的长期资产增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.23%(2017 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.24%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	48,359.34	-	-	-	48,359.34
结算备付金	255,747.21	-	-	-	255,747.21
存出保证金	16,383.24	-	-	-	16,383.24
交易性金融资产	703,080.00	29,418.00	-	11,801,547.00	12,534,045.00
应收证券清算款	-	-	-	235,800.05	235,800.05
应收利息	-	-	-	20,569.93	20,569.93
应收申购款	-	-	-	4,680.97	4,680.97
资产总计	1,023,569.79	29,418.00	-	12,062,597.95	13,115,585.74
负债					
应付证券清算款	-	-	-	194,681.82	194,681.82
应付赎回款	-	-	-	8,798.46	8,798.46
应付管理人报酬	-	-	-	6,726.62	6,726.62
应付托管费	-	-	-	1,681.65	1,681.65
应付交易费用	-	-	-	31,829.79	31,829.79
应交税费	-	-	-	2.41	2.41
其他负债	-	-	-	66,500.00	66,500.00
负债总计	-	-	-	310,220.75	310,220.75
利率敏感度缺口	1,023,569.79	29,418.00	-	11,752,377.20	12,805,364.99
上年度末 2017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	3,320,726.85	-	-	-	3,320,726.85
结算备付金	109,233.55	-	-	-	109,233.55
存出保证金	39,307.02	-	-	-	39,307.02
交易性金融资产	-	-	497,246.00	7,813,478.00	8,310,724.00
应收利息	-	-	-	10,282.04	10,282.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,469,267.42	-	497,246.00	7,823,760.04	11,790,273.46
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	5,999.22	5,999.22
应付托管费	-	-	-	1,499.77	1,499.77

应付交易费用	-	-	-	55,252.80	55,252.80
其他负债	-	-	-	69,000.00	69,000.00
负债总计	-	-	-	131,751.79	131,751.79
利率敏感度缺口	3,469,267.42	-	-497,246.00	7,692,008.25	11,658,521.67

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.72% (2017 年 12 月 31 日：4.27%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金在深度把握中国经济发展与转型的基础上，通过自上而下的宏观-中观-微观的资产配置策略，以及自下而上的精选行业、个股的基本面分析策略，再通过定性分析和定量分析相结合的选股方法，辅以多种事件驱动、量化研究等工具策略，在风险管理的前提下因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产长期增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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	11,801,547.00	92.16	7,813,478.00	67.02
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	732,498.00	5.72	497,246.00	4.27
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	12,534,045.00	97.88	8,310,724.00	71.28

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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: 人民币元)	
		本期末 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上涨 5%	574,013.12	291,683.57
	沪深 300 指数下降 5%	-574,013.12	-291,683.57

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 11,568,839.00 元，属于第二层次的余额为 965,206.00 元，无属于第三层次的余额。(2017 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 7,813,478.00 元，属于第二层次的余额为 497,246.00 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，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	11,801,547.00	89.98
	其中：股票	11,801,547.00	89.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	732,498.00	5.58
	其中：债券	732,498.00	5.58
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	304,106.55	2.32
8	其他各项资产	277,434.19	2.12
9	合计	13,115,585.74	100.00

8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	371,552.00	2.90
C	制造业	7,321,052.00	57.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	591,270.00	4.62
E	建筑业	142,061.00	1.11
F	批发和零售业	591,894.00	4.62
G	交通运输、仓储和邮政业	559,700.00	4.37
H	住宿和餐饮业	122,904.00	0.96
I	信息传输、软件和信息技术服务业	144,152.00	1.13
J	金融业	950,417.00	7.42
K	房地产业	484,039.00	3.78
L	租赁和商务服务业	239,293.00	1.87
M	科学研究和技术服务业	95,490.00	0.75

N	水利、环境和公共设施管理业	96,957.00	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	47,470.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	43,296.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	11,801,547.00	92.16

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港股通投资股票。

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	600051	宁波联合	26,100	140,679.00	1.10
2	603288	海天味业	2,000	137,600.00	1.07
3	600030	中信证券	8,400	134,484.00	1.05
4	603899	晨光文具	4,400	133,100.00	1.04
5	600566	济川药业	3,700	124,061.00	0.97
6	002706	良信电器	20,100	124,017.00	0.97
7	002186	全聚德	10,800	122,904.00	0.96
8	603868	飞科电器	3,200	122,176.00	0.95
9	603866	桃李面包	2,700	121,932.00	0.95
10	600132	重庆啤酒	3,900	119,847.00	0.94
11	603605	珀莱雅	2,700	118,989.00	0.93
12	600761	安徽合力	13,400	117,250.00	0.92
13	603056	德邦股份	7,000	115,850.00	0.90
14	000423	东阿阿胶	2,900	114,695.00	0.90
15	603839	安正时尚	10,700	114,490.00	0.89
16	600642	申能股份	21,100	102,968.00	0.80
17	600308	华泰股份	22,800	99,180.00	0.77
18	000708	大冶特钢	11,200	98,224.00	0.77
19	600726	华电能源	42,500	98,175.00	0.77
20	600099	林海股份	17,300	98,091.00	0.77
21	603758	秦安股份	16,200	98,010.00	0.77
22	603358	华达科技	9,100	97,825.00	0.76
23	300185	通裕重工	60,400	97,244.00	0.76
24	002033	丽江旅游	17,100	96,957.00	0.76

25	300040	九洲电气	19,700	96,924.00	0.76
26	300566	激智科技	7,300	96,360.00	0.75
27	300415	伊之密	15,900	96,354.00	0.75
28	601828	美凯龙	8,700	96,048.00	0.75
29	600168	武汉控股	16,700	96,025.00	0.75
30	002807	江阴银行	18,900	96,012.00	0.75
31	600248	延长化建	24,500	95,795.00	0.75
32	600356	恒丰纸业	17,200	94,428.00	0.74
33	000570	苏常柴 A	25,200	94,248.00	0.74
34	300338	开元股份	13,600	93,976.00	0.73
35	603031	安德利	7,900	93,931.00	0.73
36	600876	洛阳玻璃	8,200	91,184.00	0.71
37	002304	洋河股份	900	85,248.00	0.67
38	600887	伊利股份	3,600	82,368.00	0.64
39	600340	华夏幸福	3,200	81,440.00	0.64
40	000895	双汇发展	3,400	80,206.00	0.63
41	002415	海康威视	3,100	79,856.00	0.62
42	000963	华东医药	3,000	79,380.00	0.62
43	600276	恒瑞医药	1,500	79,125.00	0.62
44	600398	海澜之家	9,300	78,864.00	0.62
45	002032	苏泊尔	1,500	78,750.00	0.61
46	000651	格力电器	2,200	78,518.00	0.61
47	000333	美的集团	2,100	77,406.00	0.60
48	600519	贵州茅台	100	59,001.00	0.46
49	600185	格力地产	14,500	58,725.00	0.46
50	600104	上汽集团	2,000	53,340.00	0.42
51	002444	巨星科技	5,600	53,088.00	0.41
52	300176	鸿特科技	1,400	53,032.00	0.41
53	300620	光库科技	1,200	52,860.00	0.41
54	600483	福能股份	6,200	52,700.00	0.41
55	002798	帝欧家居	3,900	52,299.00	0.41
56	603659	璞泰来	1,100	52,140.00	0.41
57	600436	片仔癀	600	51,990.00	0.41
58	600350	山东高速	11,400	51,984.00	0.41
59	601006	大秦铁路	6,300	51,849.00	0.40
60	002813	路畅科技	2,000	51,820.00	0.40
61	600741	华域汽车	2,800	51,520.00	0.40
62	002120	韵达股份	1,700	51,510.00	0.40
63	000069	华侨城 A	8,100	51,435.00	0.40

64	000099	中信海直	9,100	51,324.00	0.40
65	300203	聚光科技	2,000	51,300.00	0.40
66	002768	国恩股份	2,300	51,290.00	0.40
67	601988	中国银行	14,200	51,262.00	0.40
68	600376	首开股份	7,100	51,049.00	0.40
69	000828	东莞控股	6,800	50,796.00	0.40
70	300473	德尔股份	1,500	50,535.00	0.39
71	002394	联发股份	5,000	50,400.00	0.39
72	603808	歌力思	3,100	50,344.00	0.39
73	300330	华虹计通	7,200	50,328.00	0.39
74	000599	青岛双星	13,600	50,320.00	0.39
75	600262	北方股份	2,900	50,315.00	0.39
76	603501	韦尔股份	1,700	49,963.00	0.39
77	300577	开润股份	1,600	49,888.00	0.39
78	300529	健帆生物	1,200	49,800.00	0.39
79	600510	黑牡丹	8,200	49,692.00	0.39
80	002109	兴化股份	14,100	49,632.00	0.39
81	002240	威华股份	6,800	49,572.00	0.39
82	002529	海源复材	7,300	49,567.00	0.39
83	603979	金诚信	6,600	49,434.00	0.39
84	300442	普丽盛	3,900	49,413.00	0.39
85	601368	绿城水务	8,500	49,215.00	0.38
86	600683	京投发展	11,800	49,206.00	0.38
87	300512	中亚股份	4,100	49,200.00	0.38
88	601608	中信重工	18,900	49,140.00	0.38
89	601998	中信银行	9,000	49,050.00	0.38
90	600415	小商品城	14,000	48,860.00	0.38
91	000568	泸州老窖	1,200	48,792.00	0.38
92	603060	国检集团	2,500	48,750.00	0.38
93	000751	锌业股份	17,100	48,735.00	0.38
94	300398	飞凯材料	3,100	48,670.00	0.38
95	601328	交通银行	8,400	48,636.00	0.38
96	002391	长青股份	4,600	48,530.00	0.38
97	000407	胜利股份	13,000	48,490.00	0.38
97	300554	三超新材	2,600	48,490.00	0.38
98	300650	太龙照明	3,600	48,456.00	0.38
99	603306	华懋科技	3,400	48,450.00	0.38
100	002347	泰尔股份	13,200	48,444.00	0.38
101	600694	大商股份	2,000	48,380.00	0.38

102	600919	江苏银行	8,100	48,357.00	0.38
103	603330	上海天洋	2,400	48,336.00	0.38
104	300417	南华仪器	3,200	48,320.00	0.38
105	601838	成都银行	6,000	48,300.00	0.38
106	000709	河钢股份	17,000	48,280.00	0.38
107	601888	中国国旅	800	48,160.00	0.38
108	603226	菲林格尔	3,000	48,150.00	0.38
109	600016	民生银行	8,400	48,132.00	0.38
110	000059	华锦股份	8,100	48,114.00	0.38
111	601717	郑煤机	8,700	48,111.00	0.38
112	600383	金地集团	5,000	48,100.00	0.38
112	600926	杭州银行	6,500	48,100.00	0.38
113	601997	贵阳银行	4,500	48,060.00	0.38
114	002800	天顺股份	2,900	48,053.00	0.38
115	600644	乐山电力	10,700	48,043.00	0.38
116	600590	泰豪科技	8,900	47,971.00	0.37
117	600561	江西长运	8,800	47,872.00	0.37
118	600461	洪城水业	8,700	47,850.00	0.37
119	601166	兴业银行	3,200	47,808.00	0.37
120	600780	通宝能源	14,800	47,804.00	0.37
121	300307	慈星股份	10,000	47,800.00	0.37
122	603686	龙马环卫	4,400	47,784.00	0.37
123	601939	建设银行	7,500	47,775.00	0.37
124	603639	海利尔	1,800	47,772.00	0.37
125	600808	马钢股份	13,800	47,748.00	0.37
126	000926	福星股份	7,800	47,736.00	0.37
127	002462	嘉事堂	3,300	47,685.00	0.37
127	601169	北京银行	8,500	47,685.00	0.37
128	000581	威孚高科	2,700	47,682.00	0.37
129	603088	宁波精达	4,200	47,628.00	0.37
130	002406	远东传动	9,000	47,610.00	0.37
131	000759	中百集团	9,000	47,520.00	0.37
132	600353	旭光股份	11,900	47,481.00	0.37
133	600763	通策医疗	1,000	47,470.00	0.37
134	600019	宝钢股份	7,300	47,450.00	0.37
135	601818	光大银行	12,800	47,360.00	0.37
136	600793	宜宾纸业	3,200	47,328.00	0.37
137	002110	三钢闽光	3,700	47,323.00	0.37
138	002258	利尔化学	3,600	47,304.00	0.37

139	000815	美利云	7,000	47,250.00	0.37
140	000898	鞍钢股份	9,200	47,196.00	0.37
141	601009	南京银行	7,300	47,158.00	0.37
142	300113	顺网科技	3,700	47,027.00	0.37
143	601229	上海银行	4,200	46,998.00	0.37
144	600507	方大特钢	4,700	46,953.00	0.37
145	600123	兰花科创	7,200	46,944.00	0.37
146	002359	北讯集团	5,700	46,797.00	0.37
147	600966	博汇纸业	14,900	46,786.00	0.37
148	600558	大西洋	14,800	46,768.00	0.37
149	000417	合肥百货	10,800	46,764.00	0.37
150	002689	远大智能	14,300	46,761.00	0.37
151	300404	博济医药	4,100	46,740.00	0.37
152	600971	恒源煤电	8,300	46,729.00	0.36
153	600699	均胜电子	2,000	46,720.00	0.36
154	601088	中国神华	2,600	46,696.00	0.36
155	600052	浙江广厦	16,200	46,656.00	0.36
156	600063	皖维高新	20,000	46,600.00	0.36
157	000488	晨鸣纸业	8,300	46,563.00	0.36
158	002128	露天煤业	6,500	46,540.00	0.36
159	300132	青松股份	4,500	46,530.00	0.36
160	600758	红阳能源	14,300	46,475.00	0.36
161	603878	武进不锈	4,100	46,453.00	0.36
162	300276	三丰智能	4,500	46,395.00	0.36
163	600103	青山纸业	18,100	46,336.00	0.36
164	002645	华宏科技	6,500	46,280.00	0.36
165	603887	城地股份	3,300	46,266.00	0.36
166	603569	长久物流	4,300	46,225.00	0.36
167	600178	东安动力	11,000	46,200.00	0.36
168	300387	富邦股份	8,200	46,166.00	0.36
169	002383	合众思壮	3,900	46,137.00	0.36
170	300121	阳谷华泰	5,400	46,116.00	0.36
171	002627	宜昌交运	7,200	46,008.00	0.36
172	601727	上海电气	9,300	45,942.00	0.36
173	300146	汤臣倍健	2,700	45,873.00	0.36
174	002442	龙星化工	6,000	45,360.00	0.35
175	002809	红墙股份	3,000	45,300.00	0.35
176	600390	五矿资本	6,500	45,240.00	0.35
176	603978	深圳新星	2,400	45,240.00	0.35

177	000825	太钢不锈	10,900	45,126.00	0.35
177	300485	赛升药业	4,600	45,126.00	0.35
178	600188	兖州煤业	5,100	44,778.00	0.35
179	300461	田中精机	2,500	44,550.00	0.35
180	000885	城发环境	6,200	44,454.00	0.35
181	600196	复星医药	1,900	44,213.00	0.35
182	601699	潞安环能	6,600	43,956.00	0.34
183	603595	东尼电子	1,400	43,932.00	0.34
184	002277	友阿股份	13,900	43,924.00	0.34
185	600751	海航科技	16,100	43,631.00	0.34
186	300584	海辰药业	1,800	43,452.00	0.34
187	002343	慈文传媒	4,800	43,296.00	0.34
188	300630	普利制药	900	39,654.00	0.31

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	300618	寒锐钴业	2,735,234.50	23.46
2	300604	长川科技	1,612,304.00	13.83
3	600741	华域汽车	1,544,240.00	13.25
4	600104	上汽集团	1,458,991.62	12.51
5	002027	分众传媒	1,383,907.00	11.87
6	002410	广联达	1,383,777.00	11.87
7	601939	建设银行	1,379,608.00	11.83
8	002371	北方华创	1,223,072.00	10.49
9	601211	国泰君安	1,208,378.00	10.36
10	300567	精测电子	1,151,272.00	9.87
11	300545	联得装备	1,132,464.71	9.71
12	600030	中信证券	1,119,775.00	9.60
13	000858	五粮液	1,115,083.00	9.56
14	300251	光线传媒	1,074,250.00	9.21
15	000001	平安银行	1,053,083.00	9.03
16	300447	全信股份	1,034,663.00	8.87
17	002343	慈文传媒	1,004,560.00	8.62

18	002555	三七互娱	976,855.00	8.38
19	000830	鲁西化工	971,557.00	8.33
20	600038	中直股份	968,495.00	8.31
21	600048	保利地产	945,330.00	8.11
22	600066	宇通客车	939,761.00	8.06
23	601688	华泰证券	889,461.58	7.63
24	603179	新泉股份	864,657.40	7.42
25	601100	恒立液压	825,671.00	7.08
26	603960	克来机电	824,873.00	7.08
27	603638	艾迪精密	814,283.00	6.98
28	600528	中铁工业	772,377.00	6.62
29	600562	国睿科技	767,833.00	6.59
30	600760	中航沈飞	758,491.00	6.51
31	601988	中国银行	719,832.00	6.17
32	603799	华友钴业	707,242.00	6.07
33	000651	格力电器	700,451.00	6.01
34	600519	贵州茅台	684,653.00	5.87
35	600016	民生银行	673,601.00	5.78
36	601328	交通银行	673,138.00	5.77
37	002458	益生股份	670,992.00	5.76
38	600686	金龙汽车	665,516.00	5.71
39	600967	内蒙一机	663,119.00	5.69
40	600486	扬农化工	645,529.00	5.54
41	600887	伊利股份	641,447.00	5.50
42	300577	开润股份	632,337.00	5.42
43	601818	光大银行	613,079.00	5.26
44	300133	华策影视	581,406.00	4.99
45	601288	农业银行	572,279.00	4.91
46	600031	三一重工	560,154.00	4.80
47	000768	中航飞机	546,695.26	4.69
48	300059	东方财富	545,638.00	4.68
49	300470	日机密封	533,627.00	4.58
50	300601	康泰生物	530,427.00	4.55
51	601717	郑煤机	518,883.00	4.45
52	002833	弘亚数控	512,176.00	4.39
53	600809	山西汾酒	510,655.00	4.38

54	000002	万 科 A	506,356.00	4.34
55	600260	凯乐科技	503,220.00	4.32
56	600015	华夏银行	496,876.00	4.26
57	600036	招商银行	487,798.00	4.18
58	600051	宁波联合	487,578.00	4.18
59	603678	火炬电子	476,381.00	4.09
60	600585	海螺水泥	475,659.00	4.08
61	000980	众泰汽车	473,128.00	4.06
62	601229	上海银行	469,610.00	4.03
63	300113	顺网科技	464,646.00	3.99
64	600000	浦发银行	452,841.00	3.88
65	603800	道森股份	451,434.00	3.87
66	601390	中国中铁	446,340.00	3.83
67	000951	中国重汽	446,261.42	3.83
68	000430	张家界	442,071.00	3.79
69	600498	烽火通信	440,882.46	3.78
70	601009	南京银行	439,365.00	3.77
71	000338	潍柴动力	439,308.00	3.77
72	002680	*ST 长生	437,845.00	3.76
73	002414	高德红外	435,808.00	3.74
74	600990	四创电子	433,982.00	3.72
75	300122	智飞生物	432,540.32	3.71
76	300642	透景生命	429,044.00	3.68
77	603757	大元泵业	427,930.00	3.67
78	600350	山东高速	427,830.00	3.67
79	300024	机器人	417,088.00	3.58
80	000625	长安汽车	410,137.00	3.52
81	002126	银轮股份	403,456.00	3.46
82	002624	完美世界	395,936.00	3.40
83	002186	全 聚 德	387,741.00	3.33
84	000069	华侨城 A	383,416.00	3.29
85	300316	晶盛机电	380,031.00	3.26
86	002472	双环传动	377,433.00	3.24
87	000776	广发证券	374,430.00	3.21
88	000786	北新建材	372,750.00	3.20
89	000898	鞍钢股份	370,988.00	3.18

90	000059	华锦股份	370,360.00	3.18
91	300629	新劲刚	368,481.00	3.16
92	300616	尚品宅配	367,426.00	3.15
93	603611	诺力股份	365,950.00	3.14
94	002299	圣农发展	339,803.00	2.91
95	002387	维信诺	334,313.00	2.87
96	601369	陕鼓动力	333,567.00	2.86
97	000425	徐工机械	332,897.00	2.86
98	002032	苏泊尔	331,150.00	2.84
99	002013	中航机电	328,462.00	2.82
100	600765	中航重机	326,946.00	2.80
101	600893	航发动力	326,668.00	2.80
102	000488	晨鸣纸业	323,756.00	2.78
103	002706	良信电器	323,097.00	2.77
104	000518	四环生物	322,780.00	2.77
105	002234	民和股份	322,222.00	2.76
106	600919	江苏银行	320,915.00	2.75
107	601601	中国太保	317,571.00	2.72
108	300558	贝达药业	315,867.00	2.71
109	600755	厦门国贸	313,538.00	2.69
110	300160	秀强股份	307,140.00	2.63
111	601828	美凯龙	306,247.00	2.63
112	603098	森特股份	299,652.20	2.57
113	601318	中国平安	299,095.00	2.57
114	600168	武汉控股	298,547.19	2.56
115	002304	洋河股份	297,170.00	2.55
116	600837	海通证券	296,422.00	2.54
117	000537	广宇发展	294,726.00	2.53
118	601998	中信银行	294,556.00	2.53
119	002286	保龄宝	294,299.00	2.52
120	601169	北京银行	293,998.00	2.52
121	300691	联合光电	285,079.00	2.45
122	600340	华夏幸福	281,620.00	2.42
123	601336	新华保险	280,785.00	2.41
124	002354	天神娱乐	279,862.00	2.40
125	002415	海康威视	278,843.00	2.39

126	300364	中文在线	278,533.00	2.39
127	300536	农尚环境	277,644.00	2.38
128	300385	雪浪环境	274,474.05	2.35
129	600566	济川药业	272,982.00	2.34
130	603899	晨光文具	272,117.00	2.33
131	000622	恒立实业	271,562.08	2.33
132	601166	兴业银行	269,248.00	2.31
133	002140	东华科技	267,024.00	2.29
134	600926	杭州银行	266,923.80	2.29
135	300442	普丽盛	266,353.00	2.28
136	601628	中国人寿	266,125.00	2.28
137	002347	泰尔股份	265,661.00	2.28
138	600188	兖州煤业	265,137.00	2.27
139	603866	桃李面包	262,595.75	2.25
140	002016	世荣兆业	261,329.74	2.24
141	603233	大参林	261,179.00	2.24
142	002322	理工环科	258,939.00	2.22
143	603229	奥翔药业	257,403.00	2.21
144	002487	大金重工	255,224.00	2.19
145	601155	新城控股	255,122.00	2.19
146	002110	三钢闽光	251,530.00	2.16
147	600268	国电南自	250,911.00	2.15
148	603829	洛凯股份	249,979.00	2.14
149	600403	大有能源	246,182.00	2.11
150	300119	瑞普生物	245,656.00	2.11
151	601368	绿城水务	245,195.00	2.10
152	600132	重庆啤酒	243,857.00	2.09
153	000423	东阿阿胶	243,628.00	2.09
154	300595	欧普康视	242,470.00	2.08
155	000539	粤电力A	240,499.00	2.06
156	603868	飞科电器	239,840.00	2.06
157	000809	铁岭新城	239,148.00	2.05
158	600276	恒瑞医药	238,817.00	2.05
159	000826	启迪桑德	237,893.00	2.04
160	000661	长春高新	234,916.00	2.01
161	601766	中国中车	234,580.00	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300618	寒锐钴业	2,521,934.88	21.63
2	300604	长川科技	1,979,060.00	16.98
3	002371	北方华创	1,659,850.00	14.24
4	600741	华域汽车	1,518,574.00	13.03
5	600104	上汽集团	1,455,798.00	12.49
6	002410	广联达	1,442,432.04	12.37
7	300545	联得装备	1,426,732.00	12.24
8	300567	精测电子	1,425,844.00	12.23
9	600038	中直股份	1,358,256.00	11.65
10	002027	分众传媒	1,318,375.00	11.31
11	601988	中国银行	1,253,645.00	10.75
12	601939	建设银行	1,246,599.00	10.69
13	000830	鲁西化工	1,213,024.00	10.40
14	600562	国睿科技	1,183,660.00	10.15
15	601211	国泰君安	1,178,588.00	10.11
16	600967	内蒙一机	1,174,392.00	10.07
17	601288	农业银行	1,158,903.00	9.94
18	000858	五粮液	1,125,460.00	9.65
19	300447	全信股份	1,012,658.00	8.69
20	000001	平安银行	1,008,302.00	8.65
21	300251	光线传媒	1,007,273.00	8.64
22	600066	宇通客车	948,346.00	8.13
23	600048	保利地产	934,888.00	8.02
24	002555	三七互娱	923,811.00	7.92
25	600030	中信证券	921,428.00	7.90
26	002343	慈文传媒	902,762.00	7.74
27	603638	艾迪精密	882,598.00	7.57
28	601688	华泰证券	821,988.00	7.05
29	601100	恒立液压	806,247.00	6.92
30	603960	克来机电	806,120.22	6.91
31	603799	华友钴业	791,901.00	6.79
32	600760	中航沈飞	783,639.00	6.72

33	000768	中航飞机	776,526.00	6.66
34	603179	新泉股份	764,269.00	6.56
35	600528	中铁工业	756,052.00	6.48
36	300558	贝达药业	754,606.00	6.47
37	002458	益生股份	716,184.00	6.14
38	000651	格力电器	643,078.00	5.52
39	000581	威孚高科	637,898.11	5.47
40	600016	民生银行	628,115.00	5.39
41	300601	康泰生物	626,944.00	5.38
42	601328	交通银行	620,442.00	5.32
43	600519	贵州茅台	618,140.00	5.30
44	300059	东方财富	613,035.00	5.26
45	600486	扬农化工	600,182.56	5.15
46	300577	开润股份	593,564.60	5.09
47	600031	三一重工	584,629.00	5.01
48	601818	光大银行	573,585.00	4.92
49	300133	华策影视	567,643.00	4.87
50	600887	伊利股份	547,962.00	4.70
51	300424	航新科技	543,411.16	4.66
52	300470	日机密封	543,312.00	4.66
53	000039	中集集团	538,740.00	4.62
54	600686	金龙汽车	534,367.00	4.58
55	601128	常熟银行	527,991.00	4.53
56	002833	弘亚数控	510,067.00	4.38
57	600015	华夏银行	506,589.00	4.35
58	600809	山西汾酒	503,184.00	4.32
59	603678	火炬电子	502,075.00	4.31
60	600260	凯乐科技	500,582.00	4.29
61	000002	万科A	483,692.00	4.15
62	600585	海螺水泥	479,037.00	4.11
63	600036	招商银行	469,453.00	4.03
64	600000	浦发银行	467,633.00	4.01
65	000430	张家界	461,671.00	3.96
66	000338	潍柴动力	451,688.00	3.87
67	300642	透景生命	443,638.36	3.81
68	601952	苏垦农发	437,582.00	3.75
69	300122	智飞生物	437,047.00	3.75
70	601717	郑煤机	436,781.00	3.75

71	000951	中国重汽	436,508.84	3.74
72	600990	四创电子	435,369.00	3.73
73	002414	高德红外	435,006.00	3.73
74	000998	隆平高科	424,990.88	3.65
75	002680	*ST 长生	423,534.00	3.63
76	000980	众泰汽车	419,654.00	3.60
77	601229	上海银行	418,918.79	3.59
78	300024	机器人	418,460.00	3.59
79	603757	大元泵业	410,739.00	3.52
80	002624	完美世界	406,465.00	3.49
81	603800	道森股份	406,164.00	3.48
82	300113	顺网科技	405,266.00	3.48
83	601390	中国中铁	402,480.00	3.45
84	600350	山东高速	381,922.00	3.28
85	601009	南京银行	381,094.00	3.27
86	600498	烽火通信	374,043.00	3.21
87	000625	长安汽车	367,747.00	3.15
88	000776	广发证券	367,145.00	3.15
89	300316	晶盛机电	361,843.00	3.10
90	300629	新劲刚	360,331.80	3.09
91	002472	双环传动	359,661.00	3.08
92	002126	银轮股份	358,235.00	3.07
93	002013	中航机电	350,152.00	3.00
94	603611	诺力股份	349,805.00	3.00
95	000786	北新建材	348,935.00	2.99
96	000425	徐工机械	347,746.00	2.98
97	300616	尚品宅配	342,968.00	2.94
98	600051	宁波联合	341,655.00	2.93
99	000518	四环生物	333,419.78	2.86
100	002387	维信诺	331,111.00	2.84
101	000622	恒立实业	325,778.00	2.79
102	000069	华侨城 A	325,457.00	2.79
103	600765	中航重机	324,651.00	2.78
104	002299	圣农发展	322,695.00	2.77
105	300097	智云股份	317,756.00	2.73
106	002286	保龄宝	317,089.00	2.72
107	300160	秀强股份	316,897.00	2.72
108	002234	民和股份	316,845.00	2.72

109	601369	陕鼓动力	315,860.00	2.71
110	600893	航发动力	315,593.00	2.71
111	000059	华锦股份	314,715.00	2.70
112	601318	中国平安	310,309.00	2.66
113	000898	鞍钢股份	309,801.00	2.66
114	601601	中国太保	308,280.00	2.64
115	600755	厦门国贸	307,633.00	2.64
116	603098	森特股份	303,273.60	2.60
117	000537	广宇发展	303,250.00	2.60
118	600837	海通证券	290,363.00	2.49
119	300364	中文在线	282,087.00	2.42
120	300691	联合光电	281,887.78	2.42
121	300536	农尚环境	277,686.00	2.38
122	300385	雪浪环境	276,752.00	2.37
123	601336	新华保险	270,484.00	2.32
124	600919	江苏银行	270,057.00	2.32
125	002140	东华科技	267,008.93	2.29
126	603229	奥翔药业	262,014.00	2.25
127	002186	全聚德	259,610.00	2.23
128	000488	晨鸣纸业	259,461.00	2.23
129	002032	苏泊尔	258,161.36	2.21
130	603829	洛凯股份	257,953.66	2.21
131	601628	中国人寿	256,422.00	2.20
132	000539	粤电力A	254,964.00	2.19
133	002016	世荣兆业	253,853.00	2.18
134	002322	理工环科	253,372.00	2.17
135	000809	铁岭新城	252,717.00	2.17
136	601969	海南矿业	250,591.00	2.15
137	300119	瑞普生物	250,291.00	2.15
138	002487	大金重工	248,912.00	2.14
139	600268	国电南自	248,402.00	2.13
140	600403	大有能源	247,966.00	2.13
141	300313	天山生物	246,497.00	2.11
142	601998	中信银行	244,416.00	2.10
143	601169	北京银行	242,960.00	2.08
144	002354	天神娱乐	237,490.00	2.04

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）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

买入股票成本（成交）总额	193,038,965.80
卖出股票收入（成交）总额	187,412,226.51

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	703,080.00	5.49
	其中：政策性金融债	703,080.00	5.49
4	企业债券	29,418.00	0.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	732,498.00	5.72

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	7,000	703,080.00	5.49
2	127395	16 吉城建	300	29,418.00	0.23

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定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	16,383.24
2	应收证券清算款	235,800.05
3	应收股利	-
4	应收利息	20,569.93
5	应收申购款	4,680.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	277,434.19

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	134,484.00	1.05	因重大资产重组停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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
460	32,054.02	13,290,238.69	90.13%	1,454,609.39	9.87%

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	220,033.40	1.4923%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年9月22日）基金份额总额	201,825,782.39
本报告期期初基金份额总额	11,391,129.58
本报告期期间基金总申购份额	4,546,751.58
减:本报告期期间基金总赎回份额	1,193,033.08
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	14,744,848.08

§ 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，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

本报告期内，库三七先生已离任本公司总经理职务，朱灿先生代任本公司总经理职务，具体信息请参见基金管理人于 2018 年 8 月 29 日披露的《新沃基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；易勇先生担任本公司总经理职务，朱灿先生不再代任本公司总经理职务，具体信息请参见 2018 年 11 月 24 日披露的《新沃基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；陈阳先生已离任本公司督察长职务，刘小舫女士担任本公司督察长职务，具体信息请参见基金管理人于 2018 年 9 月 19 日披露的《新沃基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 55,000 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员无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

	数量	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	
安信证券		289,360,747.33	23.49%	18,882.47	13.31%	-
国金证券		264,142,265.55	16.86%	32,795.26	23.11%	-
联讯证券		155,156,937.14	14.50%	12,758.55	8.99%	-
渤海证券		152,866,784.36	13.90%	11,170.19	7.87%	-
中银国际证 券		250,768,399.61	13.34%	25,958.26	18.29%	-
申万宏源证 券		141,226,743.46	10.84%	30,149.27	21.25%	-
财通证券		214,953,118.84	3.93%	1,664.64	1.17%	-
中泰证券		211,976,196.02	3.15%	8,518.96	6.00%	-

注：1、根据中国证监会《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）的规定及《新沃基金管理有限公司交易席位管理办法》，本基金管理人制定了券商选择标准和租用交易单元的程序，具体如下：

投资研究部按照《券商评估细则》完成对各往来证券经纪商的评估，评估实行评分制：分配权重（100分）=基础服务（45%）+特别服务（45%）+销售服务（10%）。

基础服务占45%权重，由研究员负责打分；特别服务占45%权重，由投资研究部负责人和研究员共同打分；销售服务占10%权重，由投资研究部负责人打分。

基础服务包括：报告、电话沟通、路演、联合调研服务等；

特别服务包括：深度推荐公司、单独调研、带上市公司上门路演、约见专家、委托课题、人员培养、重大投资机会等；

销售服务包括：日常沟通、重点推荐的沟通、研究投资工作的支持和配合。

根据以上标准对券商进行评估、确定选用交易单元的券商后，本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租赁协议，并通知基金托管人。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：报告期内新租联讯证券深圳席位（席位号001547）、渤海证券上海席位（席位号35528）、财通证券上海席位（席位号42386）和深圳席位（席位号003197）、安信证券上海席位（席位号42300）和深圳席位（席位号004571）。终止中泰证券

上海席位（席位号 37867）和深圳席位（席位号 003336）。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
安信证券	604,500.00	33.06%	6,000,000.00	12.00%	-	-
国金证券	1,224,009.61	66.94%	36,500,000.00	73.00%	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	7,000,000.00	14.00%	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	500,000.00	1.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 1 月 19 日
2	关于新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 3 月 9 日
3	新沃通盈灵活配置混合型基金托管协议	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 3 月 22 日
4	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 3 月 22 日
5	新沃基金管理有限公司关于修订旗下基金基金合同、托	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 3 月 22 日

	管协议及招募说明书等法律文件的公告		
6	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2018 年 1 号）	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 3 月 22 日
7	新沃基金管理有限公司关于增加部分代销机构为新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 3 月 28 日
8	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 3 月 30 日
9	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 3 月 30 日
10	新沃基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 4 月 2 日
11	新沃基金管理有限公司关于增加上海有鱼基金销售有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 4 月 20 日
12	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 4 月 23 日
13	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2018 年 2 号）	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 5 月 3 日
14	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2018 年 2 号）	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 5 月 3 日
15	新沃基金管理有限公司关于直销网上交易系统开通银联支付业务的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 5 月 24 日
16	新沃基金管理有限公司关于新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 6 月 29 日
17	新沃基金管理有限公司关于增加北京富国大通资产管理有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 7 月 6 日
18	新沃基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在北京	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 7 月 17 日

	恒天明泽基销售有限公司开通基金定投业务的公告		
19	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 7 月 20 日
20	新沃基金管理有限公司关于增加天津市凤凰财富基金销售有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 7 月 27 日
21	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 8 月 29 日
22	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告(摘要)	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 8 月 29 日
23	新沃基金管理有限公司关于增加上海中正达广基金销售有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 8 月 31 日
24	新沃基金管理有限公司关于增加西藏东方财富证券股份有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 8 月 31 日
25	关于新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金增加深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 9 月 11 日
26	新沃基金管理有限公司关于增加北京君德汇富基金销售有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 10 月 12 日
27	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 10 月 24 日
28	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2018 年 3 号)	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 11 月 5 日
29	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2018 年第 3 号)	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 11 月 5 日
30	新沃基金管理有限公司关于增加中期资产管理有限公司为新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 11 月 30 日

	告		
31	新沃基金管理有限公司关于增加部分代销机构为新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 11 月 30 日
32	新沃基金管理有限公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 12 月 6 日
33	新沃基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2018 年 12 月 18 日

§ 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	2018/1/1-2018/12/31	9,338,052.63	0.00	0.00	9,338,052.63	63.33%
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集注册新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

13.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

新沃基金管理有限公司

2019年3月29日