新华优选成长混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:新华基金管理股份有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年八月二十八日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华优选成长混合
基金主代码	519089
交易代码	519089
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2008年7月25日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	495,443,145.40份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	林葛
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	-8,456,731.50
本期利润	-26,946,369.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0910
本期基金份额净值增长率	-1.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2017
期末基金资产净值	595,384,098.42
期末基金份额净值	1.2017

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金申购费赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.05%	1.23%	-6.07%	1.03%	0.02%	0.20%
过去三个月	-7.47%	1.09%	-7.70%	0.91%	0.23%	0.18%
过去六个月	-1.62%	1.19%	-9.83%	0.92%	8.21%	0.27%
过去一年	-3.47%	1.20%	-2.64%	0.77%	-0.83%	0.43%
过去三年	-25.25%	2.04%	-14.81%	1.20%	-10.44%	0.84%
过去五年	21.24%	1.92%	54.14%	1.22%	-32.90%	0.70%
自基金合同生效起至今	171.09%	1.68%	29.78%	1.31%	141.31%	0.37%

注:1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深300指数,债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数,复和业绩比较基准为80%×沪深300指数+20%×上证国债指数。

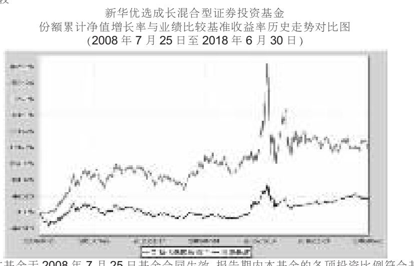
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华优选成长混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008年7月25日至2018年6月30日)



注:本基金于2008年7月25日基金合同生效,报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复,于2004年12月9日注册成立。注册地为重庆市,是我国西部首家基金管理公司。

截至2018年6月30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、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫锐混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫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、新华华丰灵活配置混合型证券投资基金和新华安享惠钰定期开放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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
付伟	本基金基金经理,新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理,新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理,新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-08-25	-	8	西安交通大学工学硕士,北京大学工商管理硕士,历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理,新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与TMT组组长,先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。
栾超	本基金基金经理,新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理,新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2018-01-05	-	6	经济学硕士,历任中邮创业基金管理股份有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。

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遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理股份有限公司作为新华优选成长混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华优选成长混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年,市场先扬后抑,上证综指下跌13.9%。在国家去杠杆,降债务的背景下,已淡化GDP高增长考核目标,经济整体平稳,市场热点持续性不强,情绪较为谨慎。本基金在上半年整体仓位中等偏低,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6月30日,本基金份额净值为1.2017元,本报告期份额净值增长率为-1.62%,同期比较基准的增长率为-9.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,贸易战、汇率贬值、去杠杆等负面因素已经被市场较为充分的预期,悲观预期已经体现在股价中。我们预期下半年随着经济的下行压力加大,财政、货币双紧的态势有望动态微调,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。展望未来,科技领域作为自上而下发力的重点,是引领中国转型升级的第一动力。宏观上看,我们国家已经进入从高速发展向高质量发展的时代,高新技术将成为提升国家长期竞争力的核心。借助国家的大力支持和产业趋势推动,拥有新技术、新模式的优秀公司将通过持续的业绩成长消化估值。战略上看,成长股作为方向型资产,将孕育比较好的投资机会。行业上看,我们看好代表未来发展方向的高科技行业,如云计算、大数据、半导体、创新药、军工、新材料等行业。从上述行业中挑选具有全球技术竞争力、行业领先地位的企业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工:

一、估值工作小组的职责分工

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

估值工作小组职责:

① 制定估值制度并在必要时修改;

② 确保估值方法符合现行法规;

③ 批准证券估值的步骤和方法;

④ 对异常情况做出决策。

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

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

二、基金会计的职责分工

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

基金会计职责:

① 获得独立、完整的证券价格信息;

② 每日证券估值;

③ 检查价格波动并进行一般准确性评估;

④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动,并在必要时向估值工作小组报告;

⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录;

⑥ 对估值调整和人工估值进行记录;

⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要,可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部门的职责分工

① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯;

② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告;

④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

四、交易部的职责分工

① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应;

② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

五、监察稽核部的职责分工

① 监督证券的整个估值过程;

② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

③ 确保公司的估值制度和方法符合现行法律、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值的风险;

⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资管理部门问讯;

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

根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《新华优选成长混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,依据2018年6月20日本基金已实现的可分配利润,对权益登记在册的本基金份额持有人进行利润分配。每一基金份额享有同等分配权;投资人可以选择现金分红或红利再投资的方式。对于未选择具体分红方式的投资者,本基金默认的分红方式是现金分红。投资人选择红利再投资方式的,现金红利转换为基金份额净值基准日为2018年6月25日,基金份额登记过户日为2018年6月26日。

本报告期共进行一次分红,每10份基金份额分配0.86元,本次分红的权益登记、除权日为2018年6月25日,现金红利发放日为2018年6月27日,分配红利总金额41,205,535.53元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管新华优选成长混合型证券投资基金的过程中,本基金托管人——中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《新华优选成长混合型证券投资基金基金合同》、《新华优选成长混合型证券投资基金托管协议》的约定,对新华优选成长混合型证券投资基金管理人——新华基金管理股份有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,新华基金管理股份有限公司在新华优选成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

中国农业银行股份有限公司托管业务部

2018年8月27日

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:新华优选成长混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	229,836,068.59	16,869,962.48
结算备付金	3,089,026.99	3,115,972.16
存出保证金	629,476.24	341,000.79
交易性金融资产	435,116,944.38	298,018,468.68
其中:股票投资	435,116,944.38	298,018,468.68
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	-	-
应收证券清算款	-	12,375,021.48
应收利息	38,165.73	5,592.02
应收股利	-	-
应收申购款	237,409.31	109,790.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	668,947,091.24	330,835,807.86
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	68,305,436.71	-
应付赎回款	277,844.34	295,346.29
应付管理人报酬	785,350.77	420,499.18
应付托管费	130,891.79	70,083.19
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,847,469.85	2,563,988.08
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	215,999.36	407,646.05
负债合计	73,562,992.82	3,757,562.79
所有者权益:	-	-
实收基金	495,443,145.40	250,262,325.30
未分配利润	99,940,953.02	76,815,919.77
所有者权益合计	595,384,098.42	327,078,245.07
负债和所有者权益总计	668,947,091.24	330,835,807.86

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.2017元,基金份额495,443,145.40份。

6.2 利润表

会计主体:新华优选成长混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-16,723,612.86	-9,935,953.27
1.利息收入	480,844.34	102,148.99
其中:存款利息收入	356,710.67	102,148.99
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	124,133.67	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,255,095.35	-10,628,631.54
其中:股票投资收益	-2,275,983.75	-11,607,296.02
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,531,079.10	978,664.48
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-18,489,638.43	570,125.71
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	30,085.88	20,403.57
减:二、费用	10,222,757.07	5,725,258.36
1. 管理人报酬	2,926,129.10	2,809,838.90
2. 托管费	487,688.15	468,306.48
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6,594,069.45	2,246,747.07
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	214,870.37	200,365.91
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-26,946,369.93	-15,661,211.63
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-26,946,369.93	-15,661,211.63

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华优选成长混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	250,262,325.30	76,815,919.77	327,078,245.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-26,946,369.93	-26,946,369.93
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)	245,180,820.10	91,276,938.71	336,457,758.81
其中:1.基金申购款	287,746,097.57	105,746,324.29	393,492,421.86
2.基金赎回款	-42,565,277.47	-14,469,385.58	-57,034,663.05
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)	-	-41,205,535.53	-41,205,535.53
五、期末所有者权益(基金净值)	495,443,145.40	99,940,953.02	595,384,098.42

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	280,393,402.41	109,553,498.62	389,946,901.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,661,211.63	-15,661,211.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-8,051,761.31	-3,500,906.60	-11,552,667.91
其中:1.基金申购款	19,070,378.87	6,844,343.68	25,914,722.55
2.基金赎回款	-27,122,140.18	-10,345,250.28	-37,467,390.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	272,341,641.10	90,391,380.39	362,733,021.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:陈重,主管会计工作负责人:张宗友,会计机构负责人:徐端骞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华优选成长股票型证券投资基金(以下简称"本基金")系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2008]377号文件"关于同意新世纪优选成长股票型证券投资基金募集的批复"批准,由新世纪基金管理有限公司(2009年9月28日对外公告更名为新华基金管理有限公司)作为发起人,于2008年5月26日至7月18日向社会公开募集,首次募集资金总额278,183,165.01元,募集资金产生利息150,291.05元,并经万隆会计师事务所有限公司万会业字[2008]第2329号验资报告予以验证。2008年7月25日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华优选成长股票型证券投资基金招募说明书》及《新华优选成长股票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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。本基金股票的投资比例占基金资产的60%—95%;其它金融工具的投资比例占基金资产的5%-40%,其中,持有的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券的合计比例不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。投资于成长性兼具品质保障的股票市值不低于股票投资的80%。

本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2018年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

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

2、营业税、增值税、企业所得税

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

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36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[2016]140号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税[2017]90号)的规定,自2018年1月1日起,证券投资基金在运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法,按照现行规定缴纳增值税及附加税费。根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定:对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

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

6.4.7 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	307,015,508.61	6.46%	42,043,910.65	2.64%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间,未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	80,000,000.00	14.55%	-	-

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	273,162.20	7.06%	120,514.97	3.13%

关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	34,336.66	2.59%	16,716.47	0.93%

注:1、上述佣金按合同约定的佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示;

2、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,926,129.10	2,809,838.90
其中:支付销售机构的客户维护费	701,122.95	858,961.59

注:基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	487,688.15	468,306.48

注:基金托管费按前一日的基金资产净值0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期与上年度可比期间,未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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

报告期内基金管理人之外的其它关联方未发生投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	229,836,068.59	321,154.37	22,590,129.13	89,367.03

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间,未参与关联方承销证券。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	网下中签	9.00	9.00	5,384.00	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	网下中签	13.09	13.09	1,765.00	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	网下中签	4.83	4.83	3,410.00	16,470.30	16,470.30	-
601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	网下中签	13.77	16.40	292,944.00	4,033,838.88	4,804,281.60	-
300385	雪浪环境	2017-12-13	2020-12-14	非公开发行	29.60	15.89	63,344.00	1,874,982.40	1,006,536.16	-
300385	雪浪环境	2017-12-13	2021-12-14	非公开发行	29.60	14.60	63,345.00	1,875,012.00	924,837.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	435,116,944.38	65.05
	其中:股票	435,116,944.38	65.05
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	232,925,095.58	34.82
7	其他各项资产	905,051.28	0.14
8	合计	668,947,091.24	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	22,194,000.00	3.73
C	制造业	257,303,603.87	43.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,977,944.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	11,329,682.06	1.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,306,065.11	4.42
J	金融业	69,970,875.55	11.75
K	房地产业	39,139,987.80	6.57
L	租赁和商务服务业	5,742,000.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	435,116,944.38	73.08

7.2.2 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股票投资。

7.3 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	601398	工商银行	6,000,000	31,920,000.00	5.36
2	601939	建设银行	4,499,981	29,474,875.55	4.95
3	603019	中科曙光	600,000	27,522,000.00	4.62
4	600048	保利地产	2,199,999	26,839,987.80	4.51
5	300567	精测电子	300,000	23,880,000.00	4.01
6	601225	陕西煤业	2,700,000	22,194,000.00	3.73
7	600801	华新水泥	1,400,000	21,042,000.00	3.53
8	600808	马钢股份	5,000,000	17,950,000.00	3.01
9	600498	烽火通信	699,999	17,394,975.15	2.92
10	000768	中航飞机	999,884	15,638,185.76	2.63

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	66,300,114.28	20.27
2	600048	保利地产	57,184,236.38	17.48
3	601398	工商银行	55,093,328.00	16.84
4	603019	中科曙光	52,111,790.55	15.93
5	601336	新华保险	51,851,717.48	15.85
6	600029	南方航空	43,535,235.15	13.31
7	601225	陕西煤业	41,555,256.00	12.70
8	000768	中航飞机	40,361,386.20	12.34
9	002281	光迅科技	39,459,462.59	12.06
10	000977	浪潮信息	36,057,339.16	11.02
11	000671	阳光城	29,987,977.00	9.17
12	300567	精测电子	29,697,454.00	9.08
13	000672	上峰水泥	28,926,743.80	8.84
14	002672	东江环保	28,252,004.36	8.64
15	600690	青岛海尔	27,405,263.92	8.38
16	601117	中国化学	26,345,221.04	8.05
17	600585	海螺水泥	25,437,250.00	7.78
18	601111	中国国航	25,254,548.26	7.72
19	000333	美的集团	25,149,062.00	7.69
20	601699	潞安环能	24,075,431.50	7.36
21	600808	马钢股份	23,708,264.98	7.25
22	600028	中国石化	23,657,000.00	7.23
23	601318	中国平安	23,254,723.00	7.11
24	000002	万科A	23,228,822.58	7.10
25	002129	中环股份	22,827,359.00	6.98
26	603929	亚翔集成	21,833,109.49	6.68
27	300016	北陆药业	21,655,003.00	6.62
28	600801	华新水泥	21,391,329.81	6.54
29	601636	旗滨集团	20,943,977.09	6.40
30	001979	招商蛇口	19,755,351.00	6.04
31	601998	中信银行	19,732,398.20	6.04
32	000066	中国长城	19,659,009.13	6.01
33	002456	欧菲科技	18,985,277.80	5.80
34	300166	东方国信	18,920,501.11	5.78
35	300212	易华录	18,388,225.21	5.62
36	600760	中航沈飞	18,343,287.00	5.61
37	600271	航天信息	18,194,275.00	5.56
38	600782	新钢股份	17,733,324.00	5.42
39	600038	中直股份	17,602,144.38	5.38
40	600588	用友网络	17,498,567.00	5.35
41	600498	烽火通信	17,173,088.17	5.25
42	601818	光大银行	17,000,000.00	5.20
43	600887	伊利股份	16,976,175.00	5.19
44	600183	生益科技	16,903,202.13	5.17
45	300559	佳发教育	16,740,383.21	5.12
46	600050	中国联通	15,940,000.00	4.87
47	600893	航发动力	15,815,721.00	4.84
48	300373	扬杰科技	15,579,333.92	4.76
49	000932	华菱钢铁	14,922,003.00	4.56
50	000807	云铝股份	14,722,659.00	4.50
51	000651	格力电器	14,588,036.08	4.46
52	600606	绿地控股	14,436,698.00	4.41
53	002405	四维图新	14,364,729.12	4.39
54	600702	舍得酒业	14,280,386.00	4.37
55	600584	长电科技	14,223,915.00	4.35
56	300199	翰宇药业	14,011,129.66	4.28
57	300037	新宙邦	14,004,538.00	4.28
58	600519	贵州茅台	13,619,309.00	4.16
59	600343	航天动力	13,566,403.02	4.15
60	002338	奥普光电	13,522,241.00	4.13
61	002470	金正大	13,442,170.00	4.11
62	002675	东诚药业	13,337,114.00	4.08
63	600803	新奥股份	13,266,590.00	4.06
64	600809	山西汾酒	13,241,168.90	4.05
65	002698	博实股份	13,240,900.31	4.05
66	600258	首旅酒店	13,208,130.56	4.04
67	600884	杉杉股份	13,179,272.64	4.03
68	000898	鞍钢股份	12,710,725.71	3.89
69	600582	天地科技	12,646,838.72	3.87
70	601088	中国神华	12,483,495.12	3.82
71	000858	五粮液	12,396,399.00	3.79
72	002439	启明星辰	11,949,878.58	3.65
73	002308	威创股份	11,947,085.52	3.65
74	600340	华夏幸福	11,881,053.89	3.63
75	000789	万年青	11,802,292.72	3.61
76	600845	宝信软件	11,754,037.16	3.59
77	601600	中国铝业	11,685,000.00	3.57
78	300502	新易盛	11,602,767.00	3.55
79	601233	桐昆股份	11,303,069.60	3.46
80	002661	克明面业	11,034,821.00	3.37
81	600036	招商银行	10,887,794.29	3.33
82	600718	东软集团	10,784,470.77	3.30
83	600754	锦江股份	10,723,820.42	3.28
84	601688	华泰证券	10,593,845.00	3.24
85	002202	金风科技	10,409,410.07	3.18
86	600967	内蒙一机	10,222,132.98	3.13
87	601857	中国石油	10,220,000.00	3.12
88	600779	水井坊	10,194,763.67	3.12
89	002659	凯文教育	10,010,358.60	3.06
90	000733	振华科技	9,798,354.00	3.00
91	002146	荣盛发展	9,779,500.00	2.99
92	300383	光环新网	9,608,562.48	2.94
93	000983	西山煤电	9,496,710.30	2.90
94	603197	保隆科技	9,483,411.68	2.90
95	002273	水晶光电	9,444,550.20	2.89
96	002224	三力士	9,436,661.95	2.89
97	300302	同有科技	9,395,383.00	2.87
98	603026	石大胜华	8,966,403.89	2.74
99	600282	南钢股份	8,952,052.08	2.74
100	600567	山鹰纸业	8,872,711.40	2.71
101	000910	大亚圣象	8,848,979.00	2.71
102	300315	掌趣科技	8,603,557.91	2.63
103	002821	凯莱英	8,494,923.00	2.60
104	600188	兖州煤业	8,482,213.83	2.59
105	002156	通富微电	8,437,111.80	2.58
106	000799	酒鬼酒	8,392,741.00	2.57
107	300613	富瀚微	8,293,440.00	2.54
108	600141	兴发集团	7,947,626.08	2.43
109	300251	光线传媒	7,648,155.54	2.34
110	603589	口子窖	7,580,615.85	2.32
111	000933	神火股份	7,563,380.05	2.31
112	002559	亚威股份	7,427,052.90	2.27
113	002677	浙江美大	7,352,783.20	2.25
114	601877	正泰电器	7,276,566.84	2.22
115	002905	金逸影视	7,248,043.00	2.22
116	002916	深南电路	7,204,003.56	2.20
117	002007	华兰生物	7,194,452.40	2.20
118	600691	阳煤化工	7,170,169.00	2.19
119	601899	紫金矿业	7,125,000.00	2.18
120	000546	金圆股份	6,944,466.00	2.12
121	002876	三利谱	6,930,005.92	2.12
122	600033	福建高速	6,917,289.98	2.11
123	300607	拓斯达	6,901,344.00	2.11
124	600115	东方航空	6,748,512.26	2.06
125	600547	山东黄金	6,700,528.97	2.05
126	600196	复星医药	6,677,490.00	2.04
127	603777	来伊份	6,664,282.00	2.04
128	600623	华谊集团	6,595,483.00	2.02
129	600867	通化东宝	6,552,819.34	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600029	南方航空	42,584,201.35	13.02
2	002281	光迅科技	38,414,474.01	11.74
3	000977	浪潮信息	37,683,731.29	11.52
4	601336	新华保险	37,498,362.78	11.46
5	601939	建设银行	35,893,785.04	10.97
6	600038	中直股份	28,854,487.68	8.82
7	000671	阳光城	28,573,498.00	8.74
8	600760	中航沈飞	28,302,579.82	8.65
9	601111	中国国航	26,366,973.66	8.06
10	601117	中国化学	26,006,284.48	7.95
11	600048	保利地产	25,643,320.41	7.84
12	603019	中科曙光	25,051,395.30	7.66
13	000768	中航飞机	25,020,139.53	7.65
14	601699	潞安环能	24,149,082.70	7.38
15	601398	工商银行	24,062,515.00	7.36
16	603929	亚翔集成	23,902,930.00	7.31
17	600585	海螺水泥	23,690,934.59	7.24
18	600028	中国石化	23,410,686.00	7.16
19	601998	中信银行	22,908,533.29	7.00
20	601318	中国平安	22,210,163.48	6.79
21	600271	航天信息	20,881,093.84	6.38
22	600893	航发动力	19,944,705.00	6.10
23	000066	中国长城	19,584,640.06	5.99
24	600690	青岛海尔	19,449,247.03	5.95
25	001979	招商蛇口	19,308,983.96	5.90
26	000672	上峰水泥	19,228,936.57	5.88
27	300315	掌趣科技	19,213,261.92	5.87
28	300016	北陆药业	19,023,484.51	5.82
29	601225	陕西煤业	18,871,451.65	5.77
30	300166	东方国信	18,674,449.68	5.71
31	300212	易华录	18,385,723.40	5.62
32	600183	生益科技	18,257,548.56	5.58
33	600782	新钢股份	17,707,047.76	5.41
34	600887	伊利股份	17,612,666.32	5.38
35	601818	光大银行	16,706,272.79	5.11
36	300373	扬杰科技	16,400,256.67	5.01
37	600584	长电科技	15,756,072.33	4.82
38	600050	中国联通	15,612,438.02	4.77
39	002405	四维图新	15,607,884.10	4.77
40	600702	舍得酒业	15,307,947.00	4.68
41	002672	东江环保	15,296,819.00	4.68
42	002338	奥普光电	15,234,195.00	4.66
43	600519	贵州茅台	14,920,000.00	4.56
44	002470	金正大	14,843,464.38	4.54
45	000932	华菱钢铁	14,808,877.10	4.53
46	000807	云铝股份	13,910,495.00	4.25
47	600258	首旅酒店	13,886,637.00	4.25
48	600809	山西汾酒	13,823,507.24	4.23
49	300413	快乐购	13,726,771.36	4.20
50	600343	航天动力	13,612,174.44	4.16
51	600030	中信证券	13,524,123.63	4.13
52	002439	启明星辰	13,450,622.10	4.11
53	600803	新奥股份	13,234,123.18	4.05
54	000858	五粮液	13,195,153.00	4.03
55	600606	绿地控股	13,108,983.00	4.01
56	300199	翰宇药业	13,094,511.14	4.00
57	600884	杉杉股份	12,778,347.46	3.91
58	000333	美的集团	12,655,243.00	3.87
59	000898	鞍钢股份	12,543,000.00	3.83
60	601636	旗滨集团	12,346,405.00	3.77
61	600582	天地科技	12,122,965.28	3.71
62	601600	中国铝业	12,068,030.00	3.69
63	600967	内蒙一机	12,039,424.64	3.68
64	601088	中国神华	11,965,113.64	3.66
65	601952	苏垦农发	11,939,885.54	3.65
66	000789	万年青	11,927,150.68	3.65
67	600340	华夏幸福	11,618,981.60	3.55
68	002675	东诚药业	11,425,029.00	3.49
69	600754	锦江股份	11,356,830.59	3.47
70	600779	水井坊	11,282,596.00	3.45
71	600718	东软集团	11,095,730.00	3.39
72	600036	招商银行	11,017,413.00	3.37
73	600845	宝信软件	10,960,445.43	3.35
74	002661	克明面业	10,893,681.80	3.33
75	300567	精测电子	10,809,721.00	3.30
76	002456	欧菲科技	10,649,920.41	3.26
77	300502	新易盛	10,639,203.00	3.25
78	300037	新宙邦	10,637,170.58	3.25
79	601857	中国石油	10,507,294.00	3.21
80	300302	同有科技	10,334,418.00	3.16
81	002308	威创股份	10,156,039.82	3.11
82	601688	华泰证券	10,026,153.64	3.07
83	000983	西山煤电	10,025,250.26	3.07
84	603900	莱绅通灵	9,875,656.40	3.02
85	000733	振华科技	9,502,786.00	2.91
86	002659	凯文教育	9,495,004.04	2.90
87	300251	光线传媒	9,481,536.00	2.90
88	002202	金风科技	9,422,747.00	2.88
89	000002	万科A	9,394,845.00	2.87
90	002156	通富微电	9,329,132.76	2.85
91	600567	山鹰纸业	9,320,880.48	2.85
92	600388	龙净环保	9,187,995.00	2.81
93	600282	南钢股份	9,132,531.00	2.79
94	300558	贝达药业	8,953,488.00	2.74
95	000799	酒鬼酒	8,609,609.00	2.63
96	002821	凯莱英	8,554,063.28	2.62
97	002146	荣盛发展	8,466,863.17	2.59
98	000910	大亚圣象	8,383,620.72	2.56
99	002916	深南电路	8,271,411.00	2.53
100	002273	水晶光电	8,256,896.80	2.52
101	603728	鸣志电器	8,242,182.56	2.52
102	603197	保隆科技	8,235,020.56	2.52
103	600188	兖州煤业	8,132,907.99	2.49
104	300613	富瀚微	8,092,045.00	2.47
105	600588	用友网络	8,046,477.58	2.46
106	603026	石大胜华	8,022,680.00	2.45
107	300383	光环新网	7,993,700.00	2.44
108	603589	口子窖	7,824,588.50	2.39
109	000800	一汽轿车	7,772,854.00	2.38
110	002905	金逸影视	7,715,427.00	2.36
111	300188	美亚柏科	7,632,870.60	2.33
112	300452	山河药辅	7,576,280.00	2.32
113	601899	紫金矿业	7,324,911.00	2.24
114	002677	浙江美大	7,312,647.56	2.24
115	600547	山东黄金	7,297,207.00	2.23
116	002920	德赛西威	7,224,116.14	2.21
117	000933	神火股份	7,203,213.00	2.20
118	002007	华兰生物	7,179,917.00	2.20
119	002573	清新环境	7,158,299.00	2.19
120	300559	佳发教育	7,131,644.15	2.18
121	600136	当代明诚	7,119,699.80	2.18
122	601877	正泰电器	6,984,559.00	2.14
123	600691	阳煤化工	6,982,387.36	2.13
124	002343	慈文传媒	6,884,870.00	2.10
125	600115	东方航空	6,789,406.10	2.08
126	601328	交通银行	6,787,355.00	2.08
127	600623	华谊集团	6,649,922.00	2.03

注:本项"卖出金额"均按卖出成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	2,460,286,914.03
卖出股票的收入(成交)总额	2,302,422,816.15

注:本项"买入股票的成本(成交)总额"与"卖出股票的收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券投资。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同尚无股指期货投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期本基金无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金持有的前十名证券的发行主体本期未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。

7.12.2 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	629,476.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,165.73
5	应收申购款	237,409.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	905,051.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
15,784	31,388.95	263,072,577.10	53.10%	232,370,568.30	46.90%

8.2 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	5,915.34	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008年7月25日)基金份额总额	278,333,456.06
本报告期期初基金份额总额	250,262,325.30
本报告期基金总申购份额	287,746,097.57
减:本报告期基金总赎回份额	42,565,277.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	495,443,145.40

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内,本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
华西证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	462,840,782.74	9.73%	338,476.84	8.75%	-
华泰证券	1	450,438,954.04	9.47%	329,406.10	8.51%	-
信达证券	1	377,554,636.92	7.94%	276,106.18	7.13%	-
国泰君安	1	338,276,426.97	7.11%	315,035.73	8.14%	-
恒泰证券	2	307,015,508.61	6.46%	273,162.20	7.06%	-
安信证券	1	301,047,934.92	6.33%	220,155.21	5.69%	-
齐鲁证券	1	284,888,325.22	5.99%	265,315.64	6.86%	-
中金公司	1	273,599,596.31	5.75%	254,804.40	6.58%	-
兴业证券	1	249,113,665.52	5.24%	231,999.66	6.00%	-
东吴证券	1	245,584,524.59	5.16%	179,596.34	4.64%	-
浙商证券	1	231,036,825.38	4.86%	168,957.47	4.37%	-
中信证券	2	177,081,133.79	3.72%	164,916.09	4.26%	-
东方证券	1	168,980,099.12	3.55%	123,575.35	3.19%	-
东兴证券	1	154,616,627.48	3.25%	113,070.53	2.92%	-
中信建投	1	146,218,768.62	3.08%	106,929.53	2.76%	-
国金证券	1	138,995,145.61	2.92%	129,446.81	3.35%	-
光大证券	1	129,981,759.31	2.73%	121,052.27	3.13%	-
申银万国	1	122,682,192.32	2.58%	114,253.12	2.95%	-
川财证券	1	89,220,857.58	1.88%	65,247.58	1.69%	-
华创证券	2	69,221,534.00	1.46%	50,621.57	1.31%	-
银河证券	1	21,378,297.00	0.45%	15,634.04	0.40%	-
渤海证券	1	9,641,728.00	0.20%	7,051.21	0.18%	-
招商证券	1	2,906,851.00	0.06%	2,707.20	0.07%	-
平安证券	1	2,497,552.00	0.05%	2,325.99	0.06%	-

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34个交易席位,其中报告期内新增1个交易席位,新增交易席位为:华创证券上海交易席位,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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	100,000,000.00	18.18%	-	-
恒泰证券	-	-	80,000,000.00	14.55%	-	-
安信证券	-	-	50,000,000.00	9.09%	-	-
中金公司	-	-	160,000,000.00	29.09%	-	-
东兴证券	-	-	40,000,000.00	7.27%	-	-
国金证券	-	-	80,000,000.00	14.55%	-	-
申银万国	-	-	40,000,000.00	7.27%	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180423-20180629	0.00	108,083,468.55	0.00	108,083,468.55	21.82%

产品特有风险

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;

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;

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;

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

新华基金管理股份有限公司

二〇一八年八月二十八日