新华策略精选股票型证券投资基金 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	新华策略精选股票
基金主代码	001040
交易代码	001040
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月31日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	561,670,444.28份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

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

2.3基金管理人和基金托管人

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

2.4信息披露方式

登载基金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	60,575,334.50
本期利润	-3,301,793.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0053
本期基金份额净值增长率	-2.11%
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	0.0688
期末基金资产净值	600,296,578.81
期末基金份额净值	1.069

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	-4.13%	1.85%	-6.07%	1.03%	1.94%	0.82%
过去三个月	-0.09%	1.48%	-7.70%	0.91%	7.61%	0.57%
过去六个月	-2.11%	1.52%	-9.83%	0.93%	7.72%	0.59%
过去一年	9.53%	1.22%	-2.64%	0.76%	12.17%	0.46%
过去三年	3.48%	1.67%	-14.81%	1.19%	18.29%	0.48%
自基金合同生效起至今	6.90%	1.74%	-7.94%	1.28%	14.84%	0.46%

注:1、本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华策略精选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年3月31日至2018年6月30日)

注:本基金合同于2015年3月31日生效。报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

4 管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

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

截至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
赵强	本基金基金经理,权益投资部总监,新华优选分红混合型证券投资基金基金经理。	2017-05-17	-	15	管理学硕士，历任国金基金高级研究员、英大基金基金经理、中欧基金投资经理。
钟俊	本基金基金经理助理,新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理助理、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助理、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。	2017-01-20	-	10	金融学硕士,历任新华基金风险与量化研究员,行业研究员、行业组长。
杨祺	本基金基金经理助理。	2017-01-20	-	6	工商管理硕士,历任华为技术有限公司产品经理,国泰基金管理有限公司研究员、圆信永丰基金管理有限公司研究员。

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

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理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年上半年中国经济整体发展平稳,但是下半年也面临较大的下行压力,内外部环境都错综复杂,从而给宏观经济带来较大的不确定性。上半年整体市场出现了较大的跌幅,主要原因是:2018年政策围绕"防风险"这最重要的攻坚战展开,因此坚定去杠杆,加强金融监管,抑制房地产市场泡沫。宏观政策对股市偏负面,资金持续偏紧,信用风险较高,经济增速将趋缓。特别是中美贸易摩擦将对中国的出口和产业政策将产生重要影响,使得投资者对未来信心不足,市场出现了较大跌幅。

上半年,本基金仓位波动不大,继续保持中高仓位,虽然短期面临各种不利因素,但是我们坚信持有优质公司终究能够在中长期内抵御市场波动风险,并取得较好的回报,因此我们并没有大幅减仓。在行业选择上,重点配置了稳健成长的白马蓝筹股,主要持仓与以前变动不大,主要是性价比比较明显、回报率较高,现金流优异的家电、地产、建材、食品饮料等行业龙头,对于涨幅较高的新兴产业进行了减持。在公司选择上,我们继续坚持选择具备核心竞争优势的白马龙头公司,通过深入的基本面和财务分析,把公司的投入资本回报率(ROIC)和公司业绩增速(g)与公司估值(pe)三者结合起来甄选个股,特别是高ROIC,经营现金流良好的优质公司是重点配置的对象。我们相信,随着时间的推移,高ROIC的优质公司一定会给投资者创造丰厚的回报,我们坚信这种理念,并将持之以恒坚持下去。我们将一如既往的坚持价值投资的方向不动摇,不畏短期波动,不去追风,不去博弈,减少换手,坚持在能力范围内进行投资,投资上有所为有所不为,努力去战胜人性贪婪与恐惧的弱点,我们坚信只有在合理的价格区间内,买入优质的公司,才能给股东创造真正的价值。

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1.069元,本报告期份额净值增长率为-2.11%,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

展望下半年,我们看到近期宏观政策也出现了微调,政策上对于可能的内外部不利因素进行提前防范,这给市场提供了反弹的契机。我们将继续去寻找能够穿越股市周期的价值成长型公司进行长期投资,尽量减少仓位的大幅波动。放眼全球,海外成熟发达国家证券市场中优质公司的长牛走势，已经给我们提供了非常好的指引方向。特别是今年中国将正式加入MSCI新兴市场指数,外资将会持续流入,中国也会更加开放,A股市场的估值和定价体系也必将逐渐与国际接轨,因此我们要以国际化的眼光去筛选公司,更加注重公司核心竞争力、财务状况和估值的分析。在目前不确定的投资环境中,也迫使我们用更加严格苛刻的标准去甄选优质公司,只要这样才可能抵抗市场的下跌,抵御系统风险的影响。下半年我们更加关注中国消费升级和产业升级两个确定的发展方向。我们对中国经济的长期前景保持乐观,作为全球第二大经济体,中国也必将涌现出众多世界级的龙头公司,也会给长期投资者带来丰厚的回报。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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格的风险;

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

本报告期内,本基金未进行利润分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司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本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:新华策略精选股票型证券投资基金

报告截止日: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	50,815,296.24	47,815,425.40
结算备付金	1,215,530.15	2,562,167.92
存出保证金	331,995.24	844,656.46
交易性金融资产	555,235,019.46	762,735,192.37
其中:股票投资	555,235,019.46	762,735,192.37
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	113,020.63	16,076,053.88
应收利息	8,759.55	12,368.01
应收股利	-	-
应收申购款	300,847.53	66,712.97
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	608,020,468.80	830,112,577.01
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	2,348,388.65	-
应付赎回款	2,049,258.71	4,592,647.40
应付管理人报酬	795,528.76	1,055,310.71
应付托管费	132,588.13	175,885.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,169,893.02	2,711,096.11
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	228,232.72	460,234.41
负债合计	7,723,889.99	8,995,173.75
所有者权益:	-	-
实收基金	561,670,444.28	752,245,139.51
未分配利润	38,626,134.53	68,872,263.75
所有者权益合计	600,296,578.81	821,117,403.26
负债和所有者权益总计	608,020,468.80	830,112,577.01

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.069元,基金份额总额561,670,444.28份。

6.2利润表

会计主体:新华策略精选股票型证券投资基金

本报告期: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	5,299,333.87	11,399,584.86
1.利息收入	208,793.04	495,054.14
其中:存款利息收入	208,793.04	388,793.55
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	106,260.59
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	68,810,169.70	-105,312,756.24
其中:股票投资收益	60,123,441.09	-112,390,241.36
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	8,686,728.61	7,077,485.12
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-63,877,127.91	116,139,235.21
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	157,499.04	78,051.75
减:二、费用	8,601,127.28	13,808,509.47
1. 管理人报酬	5,149,692.49	8,020,789.04
2. 托管费	858,282.06	1,336,798.18
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,342,630.47	4,199,691.37
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	250,522.26	251,230.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-3,301,793.41	-2,408,924.61
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-3,301,793.41	-2,408,924.61

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华策略精选股票型证券投资基金

本报告期: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)	752,245,139.51	68,872,263.75	821,117,403.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,301,793.41	-3,301,793.41
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)	-190,574,695.23	-26,944,335.81	-217,519,031.04
其中:1.基金申购款	47,272,350.33	6,353,817.00	53,626,167.33
2.基金赎回款	-237,847,045.56	-33,298,152.81	-271,145,198.37
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)	561,670,444.28	38,626,134.53	600,296,578.81
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)	1,174,123,608.18	-23,162,146.31	1,150,961,461.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,408,924.61	-2,408,924.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-124,766,355.33	43,544.15	-124,722,811.18
其中:1.基金申购款	26,157,539.23	-666,583.95	25,490,955.28
2.基金赎回款	-150,923,894.56	710,128.10	-150,213,766.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,049,357,252.85	-25,527,526.77	1,023,829,726.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:陈重,主管会计工作负责人:张宗友,会计机构负责人:徐端骞

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

新华策略精选股票型证券投资基金(以下简称"本基金")系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]66号文件"关于核准新华策略精选股票型证券投资基金募集的批复",由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于2015年3月9日至3月27日向社会公开募集，首次募集资金总额4,069,427,511.95元,其中募集净认购资金金额4,068,919,005.90元,募集资金产生利息508,506.05元,并经瑞华会计师事务所有限公司瑞华验字[2015]第37000004号验资报告予以验证。2015年3月31日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

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》、《新华策略精选股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与上年度一致、会计估计与上年度一致。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6税项

1、印花税

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

2、营业税、增值税、企业所得税

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

根据《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

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2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	218,216,362.60	13.84%	85,044,196.53	2.83%

6.4.8.1.2权证交易

本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3债券交易

本报告期及上年度可比期间,本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5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	201,867.65	15.45%	82,845.59	3.82%
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	75,420.90	3.12%	61,594.91	2.67%

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	5,149,692.49	8,020,789.04
其中:支付销售机构的客户维护费	2,509,619.43	3,854,659.96

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

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额，上年度可比期间列示的支付销售机构的客户维护费为当期支付金额。

6.4.8.2.2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	858,282.06	1,336,798.18

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4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

份额单位:份

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
期初持有的基金份额	-	12,134,708.74
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	12,134,708.74
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.16%

注:报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

报告期末,除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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
农业银行	50,815,296.24	193,065.60	109,487,748.86	371,723.93

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间,本基金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	527,300.00	7,260,921.00	8,647,720.00	-
300385	雪浪环境	2017-12-13	2020-12-14	非公开发行	29.60	15.89	101,351.00	2,999,989.60	1,610,467.39	-
300385	雪浪环境	2017-12-13	2021-12-14	非公开发行	29.60	14.60	101,352.00	3,000,019.20	1,479,739.20	-

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600745	闻泰科技	2018-04-17	重大资产重组,停牌	25.56	-	-	400,000.00	12,615,026.00	10,224,000.00	-

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	555,235,019.46	91.32
	其中:股票	555,235,019.46	91.32
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	52,030,826.39	8.56
7	其他各项资产	754,622.95	0.12
8	合计	608,020,468.80	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	-	-
C	制造业	407,506,676.07	67.88
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	-	-
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	4,320,000.00	0.72
J	金融业	7,962,500.00	1.33
K	房地产业	107,729,160.60	17.95
L	租赁和商务服务业	27,563,896.80	4.59
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	555,235,019.46	92.49

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末,本基金未持有港股通投资的股票。

7.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	600690	青岛海尔	2,500,000	48,150,000.00	8.02
2	600585	海螺水泥	1,300,000	43,524,000.00	7.25
3	002372	伟星新材	2,071,912	36,652,123.28	6.11
4	600048	保利地产	3,000,000	36,600,000.00	6.10
5	001979	招商蛇口	1,900,036	36,195,685.80	6.03
6	600809	山西汾酒	499,905	31,439,025.45	5.24
7	000333	美的集团	600,805	31,374,037.10	5.23
8	002027	分众传媒	2,880,240	27,563,896.80	4.59
9	600201	生物股份	1,560,000	26,660,400.00	4.44
10	000002	万科A	999,938	24,598,474.80	4.10

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	600809	山西汾酒	33,657,789.85	4.10
2	000656	金科股份	29,382,274.80	3.58
3	002027	分众传媒	27,087,037.60	3.30
4	000651	格力电器	26,635,537.05	3.24
5	000568	泸州老窖	23,352,376.40	2.84
6	603338	浙江鼎力	21,470,822.96	2.61
7	000858	五粮液	21,224,786.00	2.58
8	600782	新钢股份	19,992,113.28	2.43
9	600352	浙江龙盛	19,445,515.43	2.37
10	000877	天山股份	16,596,380.44	2.02
11	601225	陕西煤业	16,573,814.60	2.02
12	600702	舍得酒业	16,022,700.76	1.95
13	000786	北新建材	14,559,608.00	1.77
14	600383	金地集团	13,926,471.94	1.70
15	600837	海通证券	13,849,202.25	1.69
16	601636	旗滨集团	13,397,538.50	1.63
17	000002	万科A	11,821,360.70	1.44
18	600690	青岛海尔	11,686,936.00	1.42
19	002146	荣盛发展	11,532,983.00	1.40
20	601699	潞安环能	11,426,016.00	1.39

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

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	000418	小天鹅A	49,392,886.95	6.02
2	600383	金地集团	44,044,041.86	5.36
3	600801	华新水泥	36,016,507.93	4.39
4	002120	韵达股份	32,309,454.22	3.93
5	600566	济川药业	31,521,269.45	3.84
6	000568	泸州老窖	30,154,782.00	3.67
7	002508	老板电器	30,122,429.34	3.67
8	000656	金科股份	27,958,605.69	3.40
9	000069	华侨城A	27,949,611.78	3.40
10	000671	阳光城	25,037,828.00	3.05
11	600585	海螺水泥	23,434,198.00	2.85
12	603658	安图生物	23,286,658.07	2.84
13	600782	新钢股份	20,401,433.00	2.48
14	000858	五粮液	20,209,171.00	2.46
15	000688	建新矿业	19,096,075.80	2.33
16	603816	顾家家居	17,166,893.88	2.09
17	000877	天山股份	16,573,617.20	2.02
18	601225	陕西煤业	16,443,399.78	2.00
19	002032	苏泊尔	15,393,826.45	1.87
20	601636	旗滨集团	15,179,306.00	1.85

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

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	692,638,911.65
卖出股票的收入(成交)总额	896,385,397.74

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,不考虑相关费用。

7.5期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

7.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

7.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属。

7.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金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

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

7.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12投资组合报告附注

7.12.1本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本报告期内，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	331,995.24
2	应收证券清算款	113,020.63
3	应收股利	-
4	应收利息	8,759.55
5	应收申购款	300,847.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	754,622.95

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 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
16,060	34,973.25	5,384,619.78	0.96%	556,285,824.50	99.04%

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	3,551.21	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(新华策略)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(2015年3月31日)基金份额总额	4,069,427,511.95
本报告期期初基金份额总额	752,245,139.51
本报告期基金总申购份额	47,272,350.33
减:本报告期基金总赎回份额	237,847,045.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	561,670,444.28

10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期未发生改聘会计师事务所的情况。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受稽核或处罚的情况。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 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	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	218,216,362.60	13.84%	201,867.65	15.45%	-
东吴证券	1	142,687,554.73	9.05%	104,347.60	7.99%	-
中金公司	1	132,877,044.30	8.43%	123,748.31	9.47%	-
天风证券	1	122,577,119.21	7.78%	89,640.27	6.86%	-
浙商证券	1	105,151,087.78	6.67%	76,898.10	5.89%	-
华泰证券	1	100,440,374.17	6.37%	73,451.31	5.62%	-
中信证券	2	99,901,578.08	6.34%	93,040.43	7.12%	-
国泰君安	1	82,951,596.54	5.26%	77,252.57	5.91%	-
光大证券	1	77,950,035.94	4.94%	72,595.12	5.56%	-
信达证券	1	73,313,826.34	4.65%	53,614.20	4.10%	-
兴业证券	1	72,580,154.27	4.60%	67,593.79	5.17%	-
东兴证券	1	65,710,788.64	4.17%	48,054.05	3.68%	-
安信证券	1	55,260,087.57	3.51%	40,411.91	3.09%	-
东方证券	1	43,583,788.18	2.76%	31,872.23	2.44%	-
齐鲁证券	1	40,649,303.04	2.58%	37,856.71	2.90%	-
川财证券	1	38,507,463.00	2.44%	28,160.45	2.16%	-
华创证券	2	36,229,345.69	2.30%	26,494.61	2.03%	-
平安证券	1	24,325,348.38	1.54%	22,654.11	1.73%	-
申银万国	1	16,341,307.35	1.04%	15,218.88	1.16%	-
渤海证券	1	13,194,689.00	0.84%	9,649.33	0.74%	-
国金证券	1	8,519,885.36	0.54%	7,935.18	0.61%	-
银河证券	1	4,737,069.00	0.30%	3,464.24	0.27%	-
中信建投	1	784,860.00	0.05%	573.95	0.04%	-

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、公司研究、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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

新华基金管理股份有限公司

二〇一八年八月二十八日