新华精选低波动股票型证券投资基金(原新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型) 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

2.1.1新华精选低波动股票型证券投资基金

基金名称	新华精选低波动股票型证券投资基金
基金简称	新华精选低波动股票
基金主代码	519167
交易代码	519167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月3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	474,538,910.99份

2.1.2新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

基金名称	新华鑫安保本一号混合型证券投资基金
基金简称	新华鑫安保本一号混合
基金主代码	519167
交易代码	519167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月18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	585,855,385.12份

2.2基金产品说明

2.2.1新华精选低波动股票型证券投资基金

投资目标	在具有低波动率特质的股票组合中,精选价值低估且质地优良的上市公司进行重点投资,力求在有效控制风险的前提下,实现基金净值增长率持续稳定的超越业绩比较基准。
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略及其他投资策略。
业绩比较基准	80%× 沪深300波动率加权指数收益率+20%× 上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.2.2新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

投资目标	综合运用投资组合保险策略,严格控制风险,在为投资人提供投资金额安全保证的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	在投资策略方面,本基金将主要采用可变比例组合保本策略(VPPI,Variable Proportion Portfolio Insurance)。在保本周期内,基金管理人将严格依据所选择的量化策略模型对固定收益资产和风险资产的配置比例进行动态优化调整,以达到保本和锁定部分收益的目的。同时,本基金管理人将依据与担保人或保本义务人签订的风险管理协议,对基金资产进行严格的风险控制并适时调整投资组合。
业绩比较基准	(一年期银行定期存款税后收益率+1%)×1.5
风险收益特征	本基金为积极配置的保本混合型基金,属于证券投资基金当中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	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
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		400010	100031
法定代表人		陈重	周慕冰

2.4信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文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新华精选低波动股票型证券投资基金

3.1.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年2月3日至2018年6月30日)
本期已实现收益	-60,919,668.73
本期利润	-72,576,056.24
加权平均基金份额本期利润	-0.1518
本期加权平均净值利润率	-15.49%
本期基金份额净值增长率	-14.33%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	52,278,124.75
期末可供分配基金份额利润	0.1102
期末基金资产净值	432,171,837.24
期末基金份额净值	0.9107
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-14.33%

3.1.2基金净值表现

3.1.2.1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	-5.28%	0.63%	-7.45%	0.84%	2.17%	-0.21%
过去三个月	-7.01%	0.46%	-7.57%	0.75%	0.56%	-0.29%
自基金合同生效起至今	-14.33%	0.55%	-11.87%	0.82%	-2.46%	-0.27%

注:1、本基金业绩比较基准为80%× 沪深300波动率加权指数收益率+20%× 上证国债指数收益率

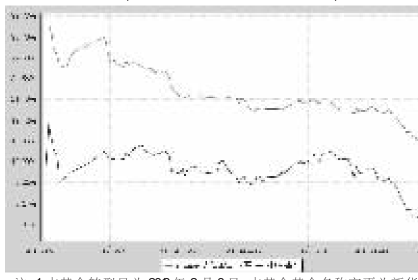
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.1.2.2自基金转型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

新华精选低波动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

(2018年2月3日至2018年6月30日)



注:1、本基金转型日为2018年2月3日,本基金基金名称变更为新华精选低波动股票型证券投资基金。

2、本基金建仓期为6个月,截至报告期末本基金处于建仓期。

3、本报告期末本基金各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

3.2.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年2月2日)
本期已实现收益	13,849,862.88
本期利润	6,178,542.88
加权平均基金份额本期利润	0.0045
本期加权平均净值利润率	0.42%
本期基金份额净值增长率	0.38%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年2月2日)
期末可供分配利润	153,682,493.26
期末可供分配基金份额利润	0.2729
期末基金资产净值	622,701,557.07
期末基金份额净值	1.0630
3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年2月2日)
基金份额累计净值增长率	32.69%

3.2.2基金净值表现

3.2.2.1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	0.38%	0.35%	0.32%	0.01%	0.06%	0.34%
过去三个月	0.57%	0.27%	0.95%	0.01%	-0.38%	0.26%
过去六个月	1.63%	0.21%	1.91%	0.01%	-0.28%	0.20%
过去一年	4.83%	0.17%	3.90%	0.01%	0.93%	0.16%
过去三年	15.27%	0.31%	12.77%	0.01%	2.50%	0.30%
自基金合同生效起2018年2月2日	32.69%	0.31%	17.06%	0.01%	15.63%	0.30%

注:1、本基金业绩比较基准为(一年期银行定期存款税后收益率+1%)× 1.5

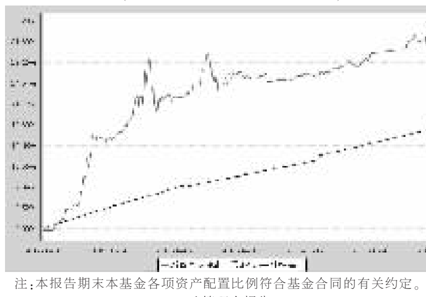
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华鑫安保本一号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

(2014年06月18日至2018年2月2日)



注:本报告期末本基金各项资产配置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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵楠	本基金基金经理,新华丰利债券型证券投资基金基金经理,新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理。	2016-05-25	-	6	经济学博士,历任新华基金管理股份有限公司宏观研究、策略研究、信用评级、基金经理助理
王滨	本基金基金经理,固定收益与平衡投资部副总监、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。	2017-07-13	-	11	管理学硕士,历任中国工商银行总行固定收益投资经理、中国民生银行投资经理、民生加银基金管理有限公司基金经理、新华基金管理股份有限公司投资经理。

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精选低波动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》、《新华精选低波动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交易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年上半年地产投资保持高位、制造业投资回暖、消费平稳支撑短期经济平稳运行,同时通胀水平维持稳定低位。在贸易战持续升温、经济预期转向悲观及信用违约风险频发的情况下,货币政策较前期显著转松。债券市场收益率出现全面下行,但信用风险出现放大趋势。股票市场在去杠杆深化、贸易摩擦升级、信用风险加剧等多重因素作用下悲观情绪继续放大,整体市场走势较为极端,其中食品饮料及医药等防御板块表现相对好于其他板块。

本基金在基金转型后以配置经营稳健的低估值低波动率蓝筹为主,但鉴于蓝筹波动率显著放大且风格因素较为极端,导致本应相对稳定的蓝筹跌幅较深,净值出现了较大回撤。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额净值为0.9107元,自本基金第三个保本期到期操作期间截止日的次日(2018年2月3日)起至本报告期期末,本基金份额净值增长率为-14.33%,同期业绩比较基准收益率为-11.87%。

截止本基金第三个保本期到期操作期间截止日(2018年2月2日),原新华鑫安保本一号混合型证券投资基金份额净值为1.0630元。本报告期内(2018年1月1日至2018年2月2日),原新华鑫安保本一号混合型证券投资基金份额净值增长率为0.38%,同期业绩比较基准收益率为0.34%。

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,房地产及地产产业链下行压力加大,外部环境不确定性仍然较高,对经济平稳增长构成一定压力,PPI、CPI价格增速预计温和适中,去杠杆政策节奏预计适度放缓。在此背景下,宽货币的基调不会改变,政策将更多关注宽信用稳经济的效果。目前股票市场在多重负面因素压制下持续调整,市场悲观预期持续发酵,但整体估值已经趋于低估,部分板块更是创下历史新低。长期来看市场机会显著大于风险,但短期内市场在内外负面因素的影响下仍需要谨慎应对。

未来具体投资方向将调整仓位逐步加仓配置行业发展空间大、国家鼓励支持的新经济行业,同时配置部分股价调整幅度和时间充分,基本面出现一定底部改善的行业。

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

本报告期本基金从2018年5月14日到2018年6月29日连续34个工作日基金持有人数低于200户。

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新华精选低波动股票型证券投资基金

6.1.1资产负债表

会计主体:新华精选低波动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
资产:	
银行存款	16,086,923.36
结算备付金	1,763,221.09
存出保证金	727,874.53
交易性金融资产	272,743,702.30
其中:股票投资	212,619,702.30
基金投资	-
债券投资	60,124,000.00
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	153,440,415.13
应收证券清算款	5,540,937.53
应收利息	1,115,973.11
应收股利	-
应收申购款	998.50
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	451,420,045.55
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30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	16,472,123.92
应付赎回款	-
应付管理人报酬	553,093.39
应付托管费	73,745.76
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,917,061.03
应交税费	4,075.34
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	228,108.87
负债合计	19,248,208.31
所有者权益:	
实收基金	379,893,712.49
未分配利润	52,278,124.75
所有者权益合计	432,171,837.24
负债和所有者权益总计	451,420,045.55

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.9107元,基金份额474,538,910.99份。

6.1.2利润表

会计主体:新华精选低波动股票型证券投资基金

本报告期:2018年2月3日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
一、收入	-66,049,429.77
1.利息收入	3,530,855.56
其中:存款利息收入	214,741.25
债券利息收入	1,258,887.49
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,057,226.82
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-57,924,059.36
其中:股票投资收益	-60,334,823.24
基金投资收益	-
债券投资收益	223,026.58
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	2,187,737.30
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-11,656,387.51
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	161.54
减:二、费用	6,526,626.47
1. 管理人报酬	2,865,077.06
2. 托管费	382,010.27
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	3,047,642.73
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	3,522.29
7. 其他费用	228,374.12
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-72,576,056.24
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-72,576,056.24

6.1.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华精选低波动股票型证券投资基金

本报告期:2018年2月3日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月3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)	469,019,063.81	153,682,493.26	622,701,557.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-72,576,056.24	-72,576,056.24
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)	-89,125,351.32	-28,828,312.27	-117,953,663.59
其中:1.基金申购款	62,511.03	12,393.99	74,905.02
2.基金赎回款	-89,187,862.35	-28,840,706.26	-118,028,568.61
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)	379,893,712.49	52,278,124.75	432,171,837.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1.1至6.1.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:陈重,主管会计工作负责人:张宗友,会计机构负责人:徐端骞

6.1.4报表附注

6.1.4.1基金基本情况

新华精选低波动股票型证券投资基金由新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型而成。

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2014年4月2日经中国证监会证监许可[2014]351号文准予募集注册,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。新华鑫安保本一号混合型证券投资基金自2014年5月26日至2014年6月13日进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会机构部函[2014]552号确认,《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》于2014年6月18日生效。

根据《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》的约定,保本周期届满时,若新华鑫安保本一号混合型证券投资基金未能符合保本基金存续条件,则转型为非保本的股票型证券投资基金,基金名称相应变更为"新华精选低波动股票型证券投资基金"。新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年1月26日第三个保本周期到期不符合保本基金存续条件,2018年2月3日起新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型为新华精选低波动股票型证券投资基金,《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》生效。

本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为80—95%,其中投资于本基金界定的低波动率股票的比例不低于非现金资产的80%,债券投资占基金资产的比例范围为0—20%;本基金保持现金或者到期日在1年以内的政府债券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28日批准报出。

6.1.4.2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》、《新华行业轮换灵活配置混合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。

6.1.4.3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。

6.1.4.4重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告一致。

6.1.4.4.1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。本期财务报表的实际编制期间为2018年2月3日至2018年6月30日。

6.1.4.4.2记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.1.4.4.3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、贷款和应收款项、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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入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、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

(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和其他金融负债。

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包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

除衍生工具所产生的金融负债外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

6.1.4.4.4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,于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债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。

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,期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以成本进行后续计量,在摊销时产生的利得或损失,应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产;金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价,于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本;股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票,于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例,计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2)债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益,上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转债,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊,确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后,逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3)权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证),在除权日按照持有的股数及获赠比例,计算确定增加的权证数量,成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊,确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5)买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入初始成本。

买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

(6)卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

6.1.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

(1)估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。

存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值。

对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。

(2)主要资产的估值方法

①股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,按最近交易日的市场交易收盘价估值;估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

②债券投资

对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种(含上交所可交换债),选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值净价作为公允价值。

对在交易所市场上市交易的可转换债券(含深交所可交换债),采用交易所每日收盘价(估值全价)扣减上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息(算头算尾)后的价格作为公允价值。

对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券、私募债券和未上市债券,采用成本估值。

对于银行间市场上的固定收益品种,选取中国债券登记结算有限公司提供的相应品种当日的估值净价加上上一起息日至估值日每百元债券的税前应计利息(算头算尾)减去上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息(算头算尾)后的价格作为公允价值。

③如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值,本基金的管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

6.1.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.1.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

6.1.4.4.8损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于月末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.1.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

(1)利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内,按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除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,逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后,逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息收入。

(2)投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3)公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失,并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

(4)其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

6.1.4.4.10费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提;

(3)基金销售服务费(C级)按前一日基金C级资产净值0.20%年费率计提;

(4)卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的,则采用待摊或预提的方法。

6.1.4.4.11基金的收益分配政策

(1)每一基金份额享有同等的分配权;

(2)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(3)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(4)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(5)基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截至日)的时间不得超过15个工作日;

(6)法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.1.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.1.4.5.1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。

6.1.4.5.2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。

6.1.4.5.3差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.1.4.6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。

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。

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。

6.1.4.7关联方关系

6.1.4.7.1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。

6.1.4.7.2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

注:本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.8.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年2月3日至2018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	288,839,231.41	12.83%

注:本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8.2权证交易

本基金报告期未运用关联方交易单元进行权证交易。

6.1.4.8.3债券交易

1、本基金报告期未运用关联方交易单元进行债券交易。

2、本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8.4债券回购交易

1、本基金报告期未运用关联方交易单元进行债券回购交易。

2、本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8.5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2月3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	266,471.55	14.32%	108,731.22	5.73%

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。

3、本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8.6关联方报酬

6.1.4.8.6.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,865,077.06
其中:支付销售机构的客户维护费	6,302.85

注:1、本基金的管理费按前一日资金资产净值1.5%年费率计提。管理费的计算方法为:每日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

2、本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8.6.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月3日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	382,010.27

注:1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:每日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

2、本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8.6.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

1、本基金未与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

2、本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8.7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2月3日至2018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	16,086,923.36	191,213.22

注:本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8.8本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

2、本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.8.9其他关联交易事项的说明

6.1.4.8.9.1其他关联交易事项的说明

1、本基金本报告期内无其他关联交易事项。

2、本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.9期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.1.4.9.1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

6.1.4.9.1.1 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	-

6.1.4.9.2期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.9.2.1银行间市场债券正回购

1、本基金报告期无银行间债券正回购余额。

2、本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.1.4.9.2.2交易所市场债券正回购

1、本基金报告期无交易所债券正回购余额。

2、本基金转型日为2018年2月3日,截至本报告期末转型后运作未满一年。

6.2新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

6.2.1资产负债表

会计主体:新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

报告截止日:2018年2月2日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年2月2日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	436,024,714.59	236,952,230.09
结算备付金	789,507.97	2,559,227.66
存出保证金	912,574.50	636,539.90
交易性金融资产	-	1,007,411,292.76
其中:股票投资	-	288,895,344.36
基金投资	-	-
债券投资	-	718,515,948.40
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	247,008,763.51	331,161,307.74
应收证券清算款	-	-
应收利息	156,951.20	12,008,069.52
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	684,892,511.77	1,590,728,667.67
负债和所有者权益	本期末 2018年2月2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	-	-
应付赎回款	34,914,667.41	672,871.83
应付管理人报酬	24,952,226.79	269,148.73
应付托管费	228,942.10	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,858,883.48	1,598,980.78
应交税费	14,646.01	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	221,588.91	460,000.00
负债合计	62,190,954.70	3,001,001.34
所有者权益:	-	-
实收基金	469,019,063.81	1,200,810,015.08
未分配利润	153,682,493.26	386,917,651.25
所有者权益合计	622,701,557.07	1,587,727,666.33
负债和所有者权益总计	684,892,511.77	1,590,728,667.67

注:报告截止日2018年2月2日,基金份额净值1.0630元,基金份额585,855,385.12份。

(下转B350版)