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

(上接B349版)

6.2.2 利润表

会计主体:新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年2月2日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2日
一、收入	32,295,466.17
1.利息收入	5,210,101.96
其中:存款利息收入	342,964.91
债券利息收入	2,661,696.81
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,205,440.24
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	34,756,684.21
其中:股票投资收益	34,316,190.06
基金投资收益	-
债券投资收益	446,780.06
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	-6,285.91
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-7,671,320.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-
减:二、费用	26,116,923.29
1. 管理人报酬	24,952,226.79
2. 托管费	228,942.10
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	874,242.77
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	1,569.22
7. 其他费用	59,942.41
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	6,178,542.88
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	6,178,542.88

6.2.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年2月2日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2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)	1,200,810,015.08	386,917,651.25	1,587,727,666.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,178,542.88	6,178,542.88
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)	-731,790,951.27	-239,413,700.87	-971,204,652.14
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-731,790,951.27	-239,413,700.87	-971,204,652.14
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)	469,019,063.81	153,682,493.26	622,701,557.07
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)	1,200,810,015.08	313,284,198.80	1,514,094,213.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	45,328,962.69	45,328,962.69
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	1,200,810,015.08	358,613,161.49	1,559,423,176.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.2.1至6.2.4,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

6.2.4报表附注

6.2.4.1基金基本情况

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金(以下简称"本基金")系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2014]351号文件《关于核准新华鑫安保本一号混合型证券投资基金募集的批复》批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于2014年5月26日至6月13日向社会公开募集,首次募集资金总额527,969,641.22元,其中募集资金产生利息203,567.11元,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2014]37000022号验资报告予以验证。2014年6月18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。

本基金以定期开放的方式运作,即在基金保本周期内采取封闭式运作(保本周期到期日除外),期间不开放申购、赎回及转换转入转出业务;到期操作期间开放赎回和转换转出业务,不开放申购和转换转入业务;过渡期只可进行过渡期申购,不开放赎回、转换转出业务。

本基金保本周期最长为十八个月,在每一保本周期内均设置该保本周期的目标收益率,在保本周期内,如本基金份额净值累计收益率连续5个工作日达到或超过预设目标收益率,则基金管理人将在满足条件之日起10个工作日内公告本基金当前保本周期提前到期(提前到期日距离满足条件之日起不超过20个工作日),并进入到期操作期间。到期操作期间截止日次一工作日(含该日)起至下一保本周期开始日前一工作日(含该日)的时间为过渡期,最长不超过20个工作日;在过渡期最后一个工作日本基金份额净值折算为1000元。过渡期结束后,本基金将进入下一保本周期,同时重新开始计算下一保本周期的目标收益率。

根据《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,如保本周期到期后,本基金未能符合保本基金存续条件,则本基金将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"。

根据《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫安保本一号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债券(包含国债、央票、政策性金融债及所有非国家信用的固定收益类金融工具)、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将依照投资组合保本策略将基金资产配置于固定收益资产与风险资产:固定收益资产为国内依法发行交易的债券(包括国债、央行票据、政策性金融债、企业债、中小企业私募债券、可转换公司债(含分离交易的可转换公司债券)、短期融资券、中期票据、资产支持证券等)、债券回购、货币市场工具和银行存款等固定收益资产;风险资产为股票、权证等权益类资产;本基金不参与定向增发。本基金的投资组合比例为:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、货币市场工具等固定收益资产占基金资产的比例不低于60%。在每个到期操作期间的前3个月、到期操作期间、过渡期及过渡期的后3个月不受前述投资组合比例的限制;在到期操作期间和过渡期,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,在保本周期内(保本周期到期日除外),本基金不受该比例的限制。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。本基金的业绩比较标准为:1.5×(一年期银行定期存款税后收益率+1%)。

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。

6.2.4.2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。

6.2.4.3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。

6.2.4.4重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.2.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1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。

6.2.4.5.2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。

6.2.4.5.3差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.2.4.6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。

6.2.4.7关联方关系

6.2.4.7.1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。

6.2.4.7.2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:新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.8.1.1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2月2日		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	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	65,910,460.58	13.48%	8,968,954.82	0.69%

注:新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8.1.2权证交易

1.本基金报告期未运用关联方交易单元进行权证交易。

2、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8.1.3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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8.1.4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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8.1.5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2月2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	61,381.66	14.45%	97,120.72	2.27%

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	8,335.15	0.77%	8,270.14	0.83%

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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8.2关联方报酬

6.2.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2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	24,952,226.79	3,799,704.55
其中:支付销售机构的客户维护费	117,203.78	1,133,035.59

注:本基金采取固定及浮动相结合的管理费收取方式。即本基金在保本周期内收取固定管理费,在保本周期到期日收取浮动管理费。

1.本基金的固定管理费按前一日资金资产净值0.5%年费率计提。固定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×0.5%÷当年天数.

2、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。

3、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年2月2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	228,942.10	1,519,881.85

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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8.3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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8.4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2月2日		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	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	436,024,714.59	21,816.41	16,404,092.79	95,700.73

注:新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8.5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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.8.6其他关联交易事项的说明

6.2.4.8.6.1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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.9期末(2018年2月2日)本基金持有的流通受限证券

6.2.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有流通受限证券。

6.2.4.9.2期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.9.2.1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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

6.2.4.9.2.2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、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于2018年2月3日起转型更名为新华精选低波动股票型证券投资基金。

7 投资组合报告

7.1新华精选低波动股票型证券投资基金

(报告期:2018年2月3日-2018年6月30日)

7.1.1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	212,619,702.30	47.10
	其中:股票	212,619,702.30	47.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,124,000.00	13.32
	其中:债券	60,124,000.00	13.32
	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	153,440,415.13	33.99
	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	17,850,144.45	3.95
8	其他各项资产	7,385,783.67	1.64
9	合计	451,420,045.55	100.00

7.1.2报告期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1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	37,720,361.00	8.73
C	制造业	50,833,009.39	11.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,018,903.85	6.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	12,225,166.72	2.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,812,606.00	6.20
J	金融业	31,778,444.00	7.35
K	房地产业	17,780,313.20	4.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
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	8,369,672.00	1.94
S	综合	-	-
T	合计	212,619,702.30	49.20

7.1.2.2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投资组合。

7.1.3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	600900	长江电力	1,669,600	26,947,344.00	6.24
2	600028	中国石化	2,858,700	18,552,963.00	4.29
3	601318	中国平安	214,500	12,565,410.00	2.91
4	600377	宁沪高速	1,346,384	12,225,166.72	2.83
5	001979	招商蛇口	619,544	11,802,313.20	2.73
6	600030	中信证券	680,700	11,279,199.00	2.61
7	300059	东方财富	828,100	10,914,358.00	2.53
8	601225	陕西煤业	1,302,600	10,707,372.00	2.48
9	002153	石基信息	345,297	10,013,613.00	2.32
10	600660	福耀玻璃	382,800	9,841,788.00	2.28

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。

7.1.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	46,283,938.30	10.71
2	601318	中国平安	45,086,401.84	10.43
3	600028	中国石化	36,849,969.95	8.53
4	600036	招商银行	29,586,621.09	6.85
5	001979	招商蛇口	28,248,535.44	6.54
6	600660	福耀玻璃	24,950,362.08	5.77
7	601328	交通银行	24,406,009.00	5.65
8	600606	金丰投资	23,335,281.00	5.40
9	601006	大秦铁路	22,899,524.40	5.30
10	601088	中国神华	22,587,644.36	5.23
11	601939	建设银行	20,500,396.86	4.74
12	601398	工商银行	20,391,920.00	4.72
13	601336	新华保险	20,319,085.70	4.70
14	600585	海螺水泥	19,653,060.00	4.55
15	601988	中国银行	19,525,168.00	4.52
16	600377	宁沪高速	18,705,019.61	4.33
17	600019	宝钢股份	18,237,120.50	4.22
18	600004	白云机场	17,096,476.79	3.96
19	002142	宁波银行	16,573,265.60	3.83
20	000002	万科A	16,197,220.00	3.75

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。

7.1.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	28,906,132.58	6.69
2	600036	招商银行	28,211,971.55	6.53
3	601328	交通银行	23,216,277.00	5.37
4	600606	绿地控股	21,870,887.50	5.06
5	601006	大秦铁路	21,578,340.60	4.99
6	601088	中国神华	20,273,075.48	4.69
7	600900	长江电力	18,977,490.00	4.39
8	601988	中国银行	18,211,074.00	4.21
9	600028	中国石化	18,160,209.32	4.20
10	601398	工商银行	17,822,827.00	4.12
11	601336	新华保险	17,519,310.00	4.05
12	600004	白云机场	17,236,824.75	3.99
13	601939	建设银行	17,198,128.00	3.98
14	600519	贵州茅台	15,944,381.74	3.69
15	002142	宁波银行	15,625,589.57	3.62
16	000961	中南建设	14,683,118.30	3.40
17	000002	万科A	14,489,383.22	3.35
18	600660	福耀玻璃	14,077,270.24	3.26
19	601169	北京银行	13,972,286.88	3.23
20	600018	上港集团	13,810,685.00	3.20

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。

7.1.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	1,268,800,448.03
卖出股票的收入(成交)总额	984,040,774.98

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。

7.1.5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	20,000,000.00	4.63
	其中:政策性金融债	20,000,000.00	4.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,124,000.00	9.28
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	其他	-	-
9	合计	60,124,000.00	13.91

7.1.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	011800589	18京粮SCP002	400,000	40,124,000.00	9.28
2	170207	17国开07	200,000	20,000,000.00	4.63

7.1.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

7.1.8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。

7.1.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末无权证投资。

7.1.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.1.10.1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。

7.1.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

7.1.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1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。

7.1.11.2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。

7.1.12本报告期投资基金情况

7.1.12.1报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末无基金投资。

7.1.13投资组合报告附注

7.1.13.1本报告期末本基金投资的前十名证券没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.1.13.2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。

7.1.13.3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	727,874.53
2	应收证券清算款	5,540,937.53
3	应收股利	-
4	应收利息	1,115,973.11
5	应收申购款	998.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,385,783.67

7.1.13.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券投资。

7.1.13.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末前十名股票中不存在流通受限股票。

7.2新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

(报告期:2018年1月1日-2018年2月2日)

7.2.1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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	247,008,763.51	36.07
	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	436,814,222.56	63.78
8	其他各项资产	1,069,525.70	0.15
9	合计	684,892,511.77	100.00

7.2.2报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末持有股票。

7.2.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
合计	-	-

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

7.2.3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

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.2.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1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	601318	中国平安	19,535,164.61	1.23
2	600004	白云机场	15,847,661.71	1.00
3	000537	广宇发展	8,859,298.00	0.56
4	601998	中信银行	7,932,480.60	0.50
5	002142	宁波银行	7,924,222.70	0.50
6	600900	长江电力	6,456,321.00	0.41
7	000961	中南建设	6,443,442.00	0.41
8	601088	中国神华	5,902,050.00	0.37
9	600036	招商银行	4,741,860.00	0.30
10	002597	金禾实业	3,203,376.20	0.20

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。

7.2.4.2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	601318	中国平安	51,075,311.10	3.22
2	601939	建设银行	38,434,779.20	2.42
3	600036	招商银行	28,369,785.00	1.79
4	000651	格力电器	26,584,344.24	1.67
5	601601	中国太保	23,459,831.43	1.48
6	002142	宁波银行	17,841,980.60	1.12
7	600004	白云机场	16,673,920.30	1.05
8	601398	工商银行	16,291,832.65	1.03
9	601088	中国神华	15,814,650.88	1.00
10	600690	青岛海尔	14,572,462.92	0.92
11	600276	恒瑞医药	13,550,795.33	0.85
12	000333	美的集团	13,508,822.00	0.85
13	600519	贵州茅台	10,746,547.88	0.68
14	601336	新华保险	10,671,518.00	0.67
15	000895	双汇发展	10,371,309.48	0.65
16	600660	福耀玻璃	9,636,376.36	0.61
17	000537	广宇发展	9,433,784.87	0.59
18	601998	中信银行	8,538,494.73	0.54
19	000538	云南白药	8,040,638.00	0.51
20	000002	万科A	8,004,967.76	0.50

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。

7.2.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	86,845,876.82
卖出股票的收入(成交)总额	402,268,802.68

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。

7.2.5期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

7.2.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末无债券投资。

7.2.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

7.2.8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。

7.2.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末无权证投资。

7.2.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.10.1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。

7.2.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

7.2.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.11.1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。

7.2.11.2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。

7.2.12本报告期投资基金情况

7.2.12.1报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末无基金投资。

7.2.13l 投资组合报告附注

7.2.13.1本报告期末本基金投资的前十名证券没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.2.13.2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。

7.2.13.3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	912,574.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	156,951.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,069,525.70

7.2.13.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券投资。

7.2.13.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无股票投资。

8 基金份额持有人信息

8.1新华精选低波动股票型证券投资基金

(报告期:2018年2月3日-2018年6月30日)

8.1.1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
177	2,681,010.80	470,052,931.11	99.05%	4,485,979.88	0.95%

8.1.2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	2,593.62	0.00%

8.1.3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。

8.2新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

(报告期:2018年1月1日-2018年2月2日)

8.2.1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
2,278	257,179.71	478,792,526.60	81.73%	107,062,858.52	18.27%

9 开放式基金份额变动

9.1新华精选低波动股票型证券投资基金

(报告期:2018年2月3日-2018年6月30日)

单位:份

基金合同生效日(2018年2月3日)基金份额总额	585,855,385.12
本报告期期初基金份额总额	585,855,385.12
本报告期基金总申购份额	78,084.26
减:本报告期基金总赎回份额	111,394,558.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	474,538,910.99

9.2新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

(报告期:2018年1月1日-2018年2月2日)

单位:份

基金合同生效日(2014年6月18日)基金份额总额	527,969,641.22
本报告期期初基金份额总额	1,499,500,402.73
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	913,645,017.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	585,855,385.12

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

本报告期内本基金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

本基金由新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型而来,本报告期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。

10.5本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内本基金未持有基金。

10.6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。

10.7管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.8基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1新华精选低波动股票型证券投资基金

(报告期:2018年2月3日-2018年6月30日)

10.8.1.1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		应支付该券商的佣金		备注
		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	
民生证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	288,839,231.41	12.83%	266,471.55	14.32%	-
安信证券	1	185,484,928.51	8.24%	135,644.99	7.29%	-
华泰证券	1	181,178,010.77	8.05%	132,494.87	7.12%	-
中金证券	1	161,791,651.87	7.18%	150,674.82	8.10%	-
浙商证券	1	152,579,204.62	6.78%	111,581.97	6.00%	-
齐鲁证券	1	150,309,150.75	6.67%	139,983.06	7.52%	-
东吴证券	1	144,002,804.33	6.39%	105,309.70	5.66%	-
国泰君安	1	141,459,447.80	6.28%	131,741.48	7.08%	-
国金证券	1	133,802,906.96	5.94%	124,608.41	6.70%	-
天风证券	1	124,411,121.61	5.52%	90,981.86	4.89%	-
东兴证券	1	103,766,854.65	4.61%	75,885.08	4.08%	-
兴业证券	1	94,222,787.32	4.18%	87,749.71	4.71%	-
川财证券	1	71,359,763.53	3.17%	52,186.01	2.80%	-
中信建投	1	69,319,278.66	3.08%	50,693.33	2.72%	-
中信证券	2	63,986,349.15	2.84%	59,590.61	3.20%	-
信达证券	1	46,325,997.88	2.06%	33,878.24	1.82%	-
华创证券	2	42,923,659.93	1.91%	31,390.09	1.69%	-
光大证券	1	39,954,029.87	1.77%	37,209.19	2.00%	-
东方证券	1	37,114,798.51	1.65%	27,142.26	1.46%	-
申银万国	1	9,884,151.94	0.44%	9,205.14	0.49%	-
渤海证券	1	9,245,662.05	0.41%	6,761.36	0.36%	-

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。

10.8.1.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
齐鲁证券	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-

10.8.2新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

(报告期:2018年1月1日-2018年2月2日)

10.8.2.1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		应支付该券商的佣金		备注
		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	
民生证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	6,456,321.00	1.32%	4,721.49	1.11%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	53,827,233.97	11.01%	50,129.14	11.80%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	65,910,460.58	13.48%	61,381.66	14.45%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	138,202,516.23	28.26%	128,707.89	30.31%	-
浙商证券	1	12,692,069.75	2.59%	9,281.73	2.19%	-
齐鲁证券	1	21,086,094.25	4.31%	19,637.93	4.62%	-
东吴证券	1	113,625.16	0.02%	83.09	0.02%	-
国泰君安	1	34,450,858.92	7.04%	32,084.43	7.55%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	39,336,750.66	8.04%	28,767.20	6.77%	-
东兴证券	1	28,173,727.00	5.76%	20,603.23	4.85%	-
兴业证券	1	21,577,920.68	4.41%	20,095.38	4.73%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	3,543,200.91	0.72%	2,591.13	0.61%	-
华创证券	2	22,292,092.60	4.56%	16,302.30	3.84%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	41,451,807.79	8.47%	30,313.99	7.14%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

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。

10.8.2.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	434,207.65	3.99%	-	-	-	-
恒泰证券	344,790.63	3.17%	-	-	-	-
齐鲁证券	488,306.70	4.48%	-	-	-	-
东兴证券	8,803,883.10	80.84%	-	-	-	-
东方证券	819,460.07	7.52%	-	-	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1新华精选低波动股票型证券投资基金

11.1.1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	20180203-20180630	450,051,593.73	-	-	450,051,593.73	94.84%

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新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

11.2.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180202	450,051,593.73	-	-	450,051,593.73	76.82%

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。

11.3影响投资者决策的其他重要信息

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来,新华鑫安保本一号混合型证券投资基金第三个保本周期为2016年7月6日至2018年1月26日,在第三个保本周期到期后,本基金未能符合保本基金存续条件,按《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》的约定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",基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。自2018年2月3日起,修订后的《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》生效,《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

新华基金管理股份有限公司

二〇一八年八月二十八日