# 新华增怡债券型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 新华增怡债券 | |
| 基金主代码 | 519162 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年12月4日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,703,729,269.95份 | |
| 投资目标 | 本基金在严格控制投资风险并保持较高资产流动性的前提下,通过配置债券等固定收益类金融工具,追求基金资产的长期稳定增值,通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。 | |
| 投资策略 | 本基金的投资策略主要包括:大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。首先,本基金管理人将采用战略性与战术性相结合的大类资产配置策略,在基金合同规定的投资比例范围内确定各大类资产的配置比例,在严格控制基金风险的基础上,获取长期稳定的绝对收益。另外,本基金通过自下而上的个股精选策略,精选具有持续成长且估值相对合理的股票构建权益类资产投资组合,增加基金的获利能力,以提高整体的收益水平。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,预期收益和预期风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 新华基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 新华增怡债券A | 新华增怡债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519162 | 519163 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,436,420,217.46份 | 267,309,052.49份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018年7月1日-2018年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 新华增怡债券A | 新华增怡债券C |
| 1.本期已实现收益 | -3,915,436.25 | -351,569.60 |
| 2.本期利润 | 21,599,771.46 | 2,713,531.15 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0130 | 0.0138 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,647,308,711.44 | 314,933,382.26 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1468 | 1.1782 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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

1、新华增怡债券A:

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.26% | 0.27% | 0.36% | 0.14% | 0.90% | 0.13% |

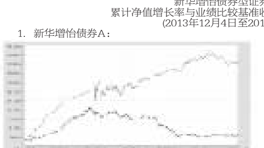
2、新华增怡债券C:

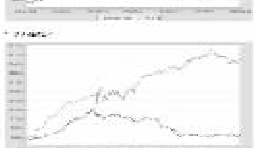
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.17% | 0.26% | 0.36% | 0.14% | 0.81% | 0.12% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

新华增怡债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年12月4日至2018年9月30日)

1. 新华增怡债券A:





注:1、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。

2、自2017年12月18日起,业绩比较基准由"中债企业债总全价指数收益率×60%+中债国债总全价指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%"变更为"中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 于泽雨 | 本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司投资总监助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)基金经理、新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理、新华安享惠钰定期开放债券型证券投资基金基金经理。 | 2013-12-04 | - | 10 | 经济学博士,历任华安财产保险公司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理。 |

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增怡债券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》、《新华增怡债券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 公平交易专项说明

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 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年三季度,从投资方面看,工业企业利润增速和房地产投资增速维持高位,内生经济仍旧具备一定韧性,但是固定资产投资增速持续下滑使得市场对未来经济回落的预期更加强烈;对外贸易方面,进出口增速整体延续震荡平稳态势,出口略有萎靡,但中美贸易争端影响开始显现,对美出口增速下降;通胀方面,受食品价格超预期上涨影响,CPI温和回升,PPI中枢则逐步下移;货币政策中性偏宽松,银行间市场流动性宽裕。

债券市场方面,在资金面持续宽松的背景下,短债表现优于长债。表外业务收缩使得部分企业的融资环境变差,违约风险增加,市场对信用债的投资趋于谨慎。具体看,利率债短端下行20bp-60bp,长端的10年期国债收益率受地方债发行挤压影响,上行14bp至3.61%,10年期国开债下行5bp至4.20%,期限利差走阔。信用债收益率短端大幅下行80bp-100bp;长端走势严重分化,中高评级信用债收益率下行20bp,低评级信用债收益率则上行20bp。

债券投资方面,本基金主要还是投资短期企业债以获得利息收益。考虑到目前的经济回落大概率是新周期中的短期现象,持续的时间和幅度可能相对有限,长期收益率继续下行的空间也相对有限。另外,金融去杠杆带来的融资环境偏紧也制约利率下行的空间,同时导致一些中等资质债券的收益相对较高。所以,三季度本基金继续配置短期企业债,重点在国有企业和上市公司中挑选股东单一、地位重要、负债率和负债规模较低或适中、产能优质的企业。

转债投资方面,目前主要是持有转股溢价率较低、流动性好、正股估值低、业绩优异的银行转债。

股票投资方面,由于持有标的总体上属于低估值、类债券品种,且企业未来经营向好,对估值修复有支持和保障,所以三季度本基金主要是以持有为主。在三季度股市结构性改善的情况下,部分持有品种有所修复。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,本基金A类份额净值为1.1468元,本报告期份额净值增长率为1.26%,同期比较基准的增长率为0.36%;本基金C类份额净值为1.1782元,本报告期份额净值增长率为1.17%,同期比较基准的增长率为0.36%;

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间,经济增长仍面临金融和实体去杠杆后续影响、中美贸易战等因素带来的压力,但是回落的幅度和时间可能相对有限。金融和实体去杠杆若干措施的出台已经在市场上形成了去杠杆的氛围,相关高杠杆主体的运行压力短期难以消化。中美贸易战时间长短也难以预期。在宏观去杠杆已经取得阶段性成效的情况下,目前政策的着眼点已经逐步转到以"债转股"为主的去杠杆、推动银行表内业务扩张、积极财政政策和大力推动高质量发展上来。今年以来的经济回落压力很大程度上是由去杠杆带来的,在目前政策已经明显转向和对冲的情况下,经济自身回落的压力可能相对有限。

债券投资方面,未来一段时间本基金还是以持有短期限企业债获取利息收益为主。考虑到资金成本持续下降,同时部分中等评级信用债被错杀,短端中等评级信用债估值和安全性更具吸引力,有相对稳定的套息空间。重点关注国资委百分之百控股、负债率相对适中、有一定竞争力的国有企业与行业龙头企业发行的债券。同时,将继续关注长久期利率债的收益率出现阶段性高的机会,本基金将逢高参与长久期利率债,合理控制杠杆,在充分保证组合流动性的同时提高收益。

可转债投资方面,转债市场急速扩容后,优质标的大幅增加,而且存量标的溢价减少,转债价值显现。我们看好未来转债市场扩容后的潜在机会,将主要通过二级市场的低吸筹码进行配置。我们将重点关注转股溢价率低、流动性好、正股估值低、业绩优异的大盘转债。

股票投资方面,由于持有的标的总体上属于低估值、类债券品种,且企业未来经营向好,对估值修复有支持和保障,所以本基金接下来主要选择继续持有这些品种。在市场已经调整到较低位置的情况下,结合持有品种的低估值属性,持有策略面临的潜在风险有限。未来主要靠时间来消化目前的调整。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 414,678,256.96 | 20.54 |
| | 其中:股票 | 414,678,256.96 | 20.54 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,514,081,116.10 | 74.99 |
| | 其中:债券 | 1,514,081,116.10 | 74.99 |
| | 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 | 37,566,296.35 | 1.86 |
| | 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 | 8,118,058.54 | 0.40 |
| 7 | 其他各项资产 | 44,587,712.87 | 2.21 |
| 8 | 合计 | 2,019,031,440.82 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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 | 94,239,324.96 | 4.80 |
| C | 制造业 | 133,461,903.18 | 6.80 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 47,184,859.00 | 2.40 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 139,792,169.82 | 7.12 |
| K | 房地产业 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | 414,678,256.96 | 21.13 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601898 | 中煤能源 | 17,848,357 | 94,239,324.96 | 4.80 |
| 2 | 601169 | 北京银行 | 14,957,590 | 91,390,874.90 | 4.66 |
| 3 | 600166 | 福田汽车 | 42,334,774 | 79,166,027.38 | 4.03 |
| 4 | 600308 | 华泰股份 | 11,478,760 | 54,294,534.80 | 2.77 |
| 5 | 601818 | 光大银行 | 12,378,267 | 48,399,023.97 | 2.47 |
| 6 | 600221 | 海航控股 | 22,904,500 | 47,183,270.00 | 2.40 |
| 7 | 000001 | 平安银行 | 119 | 1,314.95 | 0.00 |
| 8 | 600060 | 海信电器 | 100 | 1,015.00 | 0.00 |
| 9 | 601006 | 大秦铁路 | 100 | 823.00 | 0.00 |
| 10 | 600717 | 天津港 | 100 | 766.00 | 0.00 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 79,627,000.00 | 4.06 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 20,014,000.00 | 1.02 |
| | 其中:政策性金融债 | 20,014,000.00 | 1.02 |
| 4 | 企业债券 | 227,522,809.50 | 11.60 |
| 5 | 企业短期融资券 | 831,832,500.00 | 42.39 |
| 6 | 中期票据 | 228,228,500.00 | 11.63 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 126,856,306.60 | 6.46 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,514,081,116.10 | 77.16 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 113011 | 光大转债 | 1,160,980 | 125,803,792.80 | 6.41 |
| 2 | 011800730 | 18海国鑫泰SCP002 | 900,000 | 90,405,000.00 | 4.61 |
| 3 | 011800602 | 18武清经开SCP001 | 700,000 | 70,637,000.00 | 3.60 |
| 4 | 041760052 | 17内蒙电投CP001 | 600,000 | 60,624,000.00 | 3.09 |
| 5 | 011800059 | 18晋路桥SCP001 | 600,000 | 60,588,000.00 | 3.09 |

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.11.2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之外的股票。

5.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 52,538.90 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 44,494,461.68 |
| 5 | 应收申购款 | 40,712.29 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 44,587,712.87 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113011 | 光大转债 | 125,803,792.80 | 6.41 |
| 2 | 132007 | 16凤凰EB | 739,935.00 | 0.04 |
| 3 | 132004 | 15国盛EB | 159,600.00 | 0.01 |
| 4 | 128013 | 洪涛转债 | 152,005.00 | 0.01 |
| 5 | 113015 | 隆基转债 | 973.80 | 0.00 |

5.11.5报告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。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 新华增怡债券A | 新华增怡债券C |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,825,674,294.27 | 226,730,972.15 |
| 报告期基金总申购份额 | 27,174,414.67 | 154,110,130.76 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 416,428,491.48 | 113,532,050.42 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,436,420,217.46 | 267,309,052.49 |

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人于本报告期末持有本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 20180701-20180930 | 467,133,424.54 | - | 67,133,424.54 | 400,000,000.00 | 23.48% |
| 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

(一)中国证监会批准新华信用增益债券型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华信用增益债券型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华增怡债券型证券投资基金托管协议》

(四)《新华增怡债券型证券投资基金基金合同》

(五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(六)更新的《新华增怡债券型证券投资基金招募说明书》

(七)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(八)基金托管人业务资格批件及营业执照

(九)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

(十)关于以通讯方式召开新华信用增益债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

(十一)新华信用增益债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告

9.2存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司
二〇一八年十月二十四日

# 新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金
2018年第3季度报告
2018年9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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 新华战略新兴产业灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 001294 |
| 交易代码 | 001294 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年6月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 287,346,795.06份 |
| 投资目标 | 重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会,综合运用多种投资策略,精选战略新兴产业的优质企业进行投资,在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,力争为投资人提供长期稳定的绝对回报。 |
| 投资策略 | 投资策略方面,本基金将以大类资产配置为基础,采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。大类资产配置策略主要运用战略性资产配置策略和战术性资产配置策略。股票投资策略将通过对战略性新兴产业发展状况的持续跟踪,以研究员以及基金经理的实地调研、密切跟踪以及扎实的案头分析工作为基础,采用自上而下与自下而上相结合的选股策略,动态精选能够充分受益于战略性新兴产业为主题的优质股票进行投资。具体运作方法包括对战略性新兴产业界定、战略性新兴产业主题挖掘、战略性新兴产业个股挖掘等方法。债券投资策略主要运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、中小企业私募债券选择策略、收益率曲线骑乘策略以及可转换债券投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 70%*中证新兴产业指数+30%*中证综合债券指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 新华基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018年7月1日-2018年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -15,160,297.23 |
| 2.本期利润 | -17,442,465.11 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0601 |
| 4.期末基金资产净值 | 164,662,979.44 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.573 |

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。

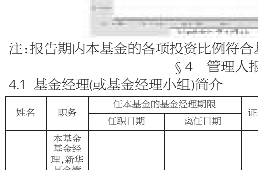
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -9.48% | 1.65% | -4.12% | 1.00% | -5.36% | 0.65% |

3.2.2自基金合同生效以来基金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

新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金
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6月29日至2018年9月30日)



注: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 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张霖 | 本基金基金经理,新华基金管理股份有限公司研究部总监。 | 2018-01-05 | - | 10 | 金融学硕士,历任长城证券有限责任公司研究所所长助理、新华基金管理股份有限公司基金经理助理。 |

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战略新兴产业灵活配置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》、《新华战略新兴产业灵活配置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 公平交易专项说明

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 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

回顾三季度,受中美贸易战影响,美债收益率迅速上行的背景之下,全球风险资产的价格均面临较大的调整压力。在中美关系不断恶化和经济数据走弱的大环境下,市场信心较为脆弱。本基金仓位变化不大,重点持有成长类行业龙头为主,对行业景气度向上具备一定核心竞争力且三季报业绩预期较好的新兴产业中长期战略配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,本基金份额净值为0.573元,本报告期份额净值增长率为-9.48%,同期比较基准的增长率为-4.12%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度:1.金融去杠杆与中美贸易摩擦虽未结束,但对A股的负面影响已经开始边际钝化;2.由于降准政策影响A股的流动性边际宽松;3.为缓解经济下行压力,我国减税、降费、促进消费的相关政策,具体措施也值得期待,政策面的利好有望带来一波估值修复行情。后期关注:1)中国信用扩张是否在四季度见效;2)美国中期选举是否加快美联储缩表进程;3)中国降低税费的举措是否能有效降低A股股权风险溢价;4)未来A股上市公司盈利的改善。虽然上述变量存在一定不确定性,且基建投资新老项目衔接可能会有时滞,预计四季度经济数据不容乐观。但目前市场整体估值已经处于历史底部区间,上证综指动态PE已达到11倍左右,低于历史市场几次底部所对应水平,因此值得左侧布局,仓位上高抛低吸,低估值蓝筹+科技基建等相关行业优质龙头企业及具长期投资价值股,如:云计算、5G、创新药、军工、金融等。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 153,355,772.18 | 89.04 |
| | 其中:股票 | 153,355,772.18 | 89.04 |
| 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 | 15,066,581.06 | 8.75 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,801,761.26 | 2.21 |
| 8 | 合计 | 172,224,114.50 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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 | 85,824,286.14 | 52.12 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,898,665.04 | 2.37 |
| E | 建筑业 | 1,895,500.00 | 1.15 |
| F | 批发和零售业 | 4,371,050.00 | 2.65 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,320,000.00 | 0.80 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 30,788,946.00 | 18.70 |
| J | 金融业 | 12,059,500.00 | 7.32 |
| K | 房地产业 | 729,000.00 | 0.44 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 8,264,715.00 | 5.02 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 4,204,120.00 | 2.55 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 153,355,772.18 | 93.13 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 603259 | 药明康德 | 89,300 | 8,264,715.00 | 5.02 |
| 2 | 300166 | 东方国信 | 630,000 | 7,830,900.00 | 4.76 |
| 3 | 603986 | 兆易创新 | 80,000 | 7,098,400.00 | 4.31 |
| 4 | 603486 | 科沃斯 | 142,978 | 6,226,691.90 | 3.78 |
| 5 | 300747 | 锐科激光 | 38,700 | 6,114,600.00 | 3.71 |
| 6 | 600703 | 三安光电 | 330,000 | 5,398,800.00 | 3.28 |
| 7 | 600487 | 亨通光电 | 200,960 | 4,800,934.40 | 2.92 |
| 8 | 600498 | 烽火通信 | 143,600 | 4,285,024.00 | 2.60 |
| 9 | 601933 | 永辉超市 | 525,000 | 4,278,750.00 | 2.60 |
| 10 | 002044 | 美年健康 | 244,000 | 4,204,120.00 | 2.55 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2本报告期,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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 310,654.11 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,477,851.44 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,616.18 |
| 5 | 应收申购款 | 9,639.53 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,801,761.26 |

5.11.4报告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。

5.11.5报告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。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 291,313,068.98 |
| 报告期基金总申购份额 | 4,367,763.51 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 8,334,037.43 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 287,346,795.06 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期末未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(六)更新的《新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(七)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(八)基金托管人业务资格批件及营业执照

(九)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司
二〇一八年十月二十四日

# 新华中小市值优选混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 新华中小市值优选混合 |
| 基金主代码 | 519097 |
| 交易代码 | 519097 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年1月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 45,108,536.92份 |
| 投资目标 | 在有效控制风险的前提下,精选各行业中具有较高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资,力求实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准。 |
| 投资策略 | 本基金以合理价格成长选股策略(GARP)为核心,精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 80%×中证700指数收益率+20%×上证国债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 新华基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2018年7月1日-2018年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -5,012,487.91 |
| 2.本期利润 | -3,942,997.46 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0877 |
| 4.期末基金资产净值 | 56,304,150.63 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.248 |

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。

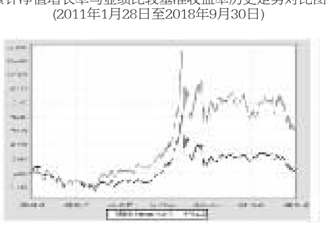
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -6.59% | 1.61% | -6.38% | 1.07% | -0.21% | 0.54% |

3.2.2自基金合同生效以来基金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

新华中小市值优选混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年1月28日至2018年9月30日)



注: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 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 付伟 | 本基金基金经理,新华优选成长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。 | 2016-06-17 | - | 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,新华优选成长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。 | 2017-07-18 | 2018-08-27 | 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。 |

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中小市值优选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》、《新华中小市值优选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 公平交易专项说明

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 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年三季度A股市场继续呈现震荡向下的走势,仅有金融、煤炭、钢铁等少数绝对估值较低的板块表现较好。本基金根据基金合同约定,精选各个行业中具有较高成长性且估值合理的中小市值股票进行投资,追求获取长期超额收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,本基金份额净值为1.248元,本报告期份额净值增长率为-6.59%,同期比较基准的增长率为-6.38%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济面临比较复杂的局面。中美贸易摩擦的影响仍在持续,未来如何演进,11月份美国中期选举之后,将是重要的观察窗口。国内方面,政府多次表态,积极的财政政策要更加积极,要以更大力度通过减税降费为企业减负,激发市场活力。当前个税改革已经逐步落地,社保征缴体制改革原则是不增加企业负担,增值税改革正在逐步推动,预计今年减税降费规模预计将超1.3万亿元。

预计A股短期将维持震荡筑底的走势,全市场整体估值水平接近历史底部。本基金将保持中性略高仓位,注意把握其中的结构性机会,更多关注新经济、新产业方面的投资机会,如科技创新、现代服务、生物医药、先进制造等板块。个股选择上,重点布局调整充分,业绩稳健,估值处于较低水平,成长性良好的个股。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 49,577,358.28 | 82.55 |
| | 其中:股票 | 49,577,358.28 | 82.55 |
| 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 | 10,351,449.72 | 17.24 |
| 7 | 其他各项资产 | 127,951.73 | 0.21 |
| 8 | 合计 | 60,056,759.73 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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 | 1,305,000.00 | 2.32 |
| C | 制造业 | 29,047,913.84 | 51.59 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 815,400.00 | 1.45 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 1,687,444.44 | 3.00 |
| 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 | 8,069,700.00 | 14.33 |
| J | 金融业 | 1,278,000.00 | 2.27 |
| K | 房地产业 | - | - |
| 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 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,611,600.00 | 2.86 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,762,300.00 | 10.23 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 49,577,358.28 | 88.05 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002371 | 北方华创 | 40,000 | 1,882,400.00 | 3.34 |
| 2 | 002343 | 慈文传媒 | 150,000 | 1,858,500.00 | 3.30 |
| 3 | 002153 | 石基信息 | 50,000 | 1,688,000.00 | 3.00 |
| 4 | 300413 | 芒果超媒 | 50,028 | 1,687,444.44 | 3.00 |
| 5 | 002025 | 航天电器 | 60,000 | 1,642,800.00 | 2.92 |
| 6 | 300347 | 泰格医药 | 30,000 | 1,611,600.00 | 2.86 |
| 7 | 600136 | 当代明诚 | 120,000 | 1,534,800.00 | 2.73 |
| 8 | 600760 | 中航沈飞 | 40,000 | 1,524,000.00 | 2.71 |
| 9 | 002007 | 华兰生物 | 40,000 | 1,516,000.00 | 2.69 |
| 10 | 600845 | 宝信软件 | 60,000 | 1,470,600.00 | 2.61 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 118,416.42 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,410.17 |
| 5 | 应收申购款 | 8,125.14 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 127,951.73 |

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 44,698,247.82 |
| 报告期基金总申购份额 | 2,122,102.08 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 1,711,812.98 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 45,108,536.92 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华中小市值优选混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华中小市值优选混合型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华中小市值优选混合型证券投资基金托管协议》

(四)《新华中小市值优选混合型证券投资基金基金合同》

(五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(六)更新的《新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书》

(七)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(八)基金托管人业务资格批件及营业执照

(九)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司
二〇一八年十月二十四日