（上接B485版）

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2019年3月27日批准报出。

7.2.4.2 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2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华鑫安保本一号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。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年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2018年2月2日的财务状况以及2018年1月1日至2018年2月2日的经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

7.2.4.4 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。

7.2.4.4.1 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1月1日至2018年2月2日。

7.2.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.2.4.4.3 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。

7.2.4.4.4 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。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。

卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

7.2.4.4.5 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（含深交所可交换债券），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。

7.2.4.4.6 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。

7.2.4.4.7 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。

7.2.4.4.8 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）。

7.2.4.4.9 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日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。

7.2.4.4.10 费用的确认和计量

（1）基金固定管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提；基金在保本周期到期日收取浮动年管理费，即本基金浮动管理费的适用费率是根据保本周期内的基金份额净值增长率的大小来决定。

（2）基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提；

（3）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；

（4）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。

7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额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；

(2) 本基金收益分配方式：

①保本周期内仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

②基金转型为“新华精选低波动股票型证券投资基金”后，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按除权日的基金份额净值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；投资者在不同销售机构可以选择不同的收益分配方式；在同一销售机构只能选择一种收益分配方式，基金登记机构将以投资者最后一次选择的收益分配方式为准；

(3) 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；

(4) 每一基金份额享受同等分配权。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1 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。

7.2.4.5.2 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。

7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

7.2.4.6 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、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、财税[2016]140 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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》：资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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。

7.2.4.7 关联方关系

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
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
北京新华盛时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东

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。

7.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.8.1.1 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12月31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%	138,414,548.89	3.39%

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。

7.2.4.8.1.2 债券交易

1、本基金报告期及上年度可比期间均无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。

7.2.4.8.1.3 债券回购交易

1、本基金本报告期及上年度可比期间均无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。

7.2.4.8.1.4 权证交易

1、本基金本报告期及上年度可比期间均无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。

7.2.4.8.1.5 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12月31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	124,630.79	3.62%	35,739.06	2.26%

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。

7.2.4.8.2 关联方报酬

7.2.4.8.2.1 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12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,962,226.79	7,764,767.78
其中：支付销售机构的客户维护费	117,203.78	2,315,407.07

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。

7.2.4.8.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	228,942.10	3,105,915.11

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。

7.2.4.8.3 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。

7.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.2.4.8.4.2 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。

7.2.4.8.5 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2月2日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	66,952,230.09	186,493.01

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。

7.2.4.8.6 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维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。

7.2.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.2.4.8.7.1 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。

7.2.4.9 期末（2018年2月2日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

1、本基金本报告期末未持有流通受限证券。

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。

§8 投资组合报告

8.1 新华精选低波动股票型证券投资基金

8.1.1 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	2,089,820.00	61.57
	其中：股票	2,089,820.00	61.57
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	–	–
	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	964,766.70	28.13
8	其他各项资产	349,733.90	10.20
9	合计	3,394,320.60	100.00

8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.1.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	326,402.00	12.54
B	采矿业	–	–
C	制造业	736,319.00	28.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	196,110.00	7.53
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	63,620.00	2.44
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	270,917.00	10.41
J	金融业	306,607.00	11.78
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	56,256.00	2.16
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	133,589.00	5.13
S	综合	–	–
	合计	2,089,820.00	80.28

8.1.3 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	601988	中国银行	46,600	168,226.00	6.46
2	601328	交通银行	23,900	138,381.00	5.32
3	002234	民和股份	9,800	112,210.00	4.31
4	002746	仙坛股份	7,900	108,072.00	4.15
5	300339	润和软件	11,700	106,704.00	4.10
6	002267	陕天然气	12,200	90,158.00	3.46
7	600850	华东电脑	5,000	78,850.00	3.03
8	002115	三维通信	7,700	75,999.00	2.92
9	002299	圣农发展	4,200	69,468.00	2.67
10	002961	克明面业	5,500	67,870.00	2.61

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 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	600900	长江电力	48,591,771.30	1,866.68
2	601318	中国平安	46,068,189.84	1,769.74
3	600028	中国石化	37,736,792.95	1,449.68
4	600276	恒瑞医药	33,061,930.60	1,270.09
5	600519	贵州茅台	32,533,436.38	1,249.79
6	600570	恒生电子	31,055,715.00	1,193.02
7	600036	招商银行	30,511,157.09	1,172.10
8	001979	招商蛇口	28,248,535.44	1,085.18
9	600271	航天信息	27,232,448.80	1,046.15
10	601328	交通银行	25,949,014.00	996.85
11	600660	福耀玻璃	24,950,362.08	958.48
12	601006	大秦铁路	24,075,831.40	924.89
13	600606	绿地控股	23,335,281.00	896.44
14	601088	中国神华	22,587,644.36	867.72
15	002153	石基信息	21,846,234.78	839.24
16	601336	新华保险	21,606,061.70	830.01
17	601398	工商银行	21,450,489.00	824.03
18	300408	三环集团	21,400,500.28	822.11
19	300059	东方财富	21,000,174.59	806.73
20	601988	中国银行	20,802,768.00	799.15

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。

8.1.4.2 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	600900	长江电力	48,691,677.03	1,870.52
2	601318	中国平安	42,157,239.58	1,619.49
3	600028	中国石化	37,042,642.51	1,423.01
4	600276	恒瑞医药	33,305,329.63	1,279.44
5	600519	贵州茅台	31,095,312.34	1,194.54
6	600036	招商银行	29,095,617.56	1,117.72
7	600271	航天信息	28,331,695.75	1,088.38
8	600570	恒生电子	28,089,769.67	1,079.08
9	601328	交通银行	24,631,379.00	946.23
10	001979	招商蛇口	24,070,709.93	924.69
11	600660	福耀玻璃	23,759,456.24	912.73
12	002153	石基信息	23,541,855.82	904.37
13	601006	大秦铁路	22,705,778.60	872.26
14	300408	三环集团	22,625,846.05	869.18
15	600606	绿地控股	21,870,887.50	840.18
16	300059	东方财富	20,887,988.19	802.42
17	601088	中国神华	20,273,075.48	778.80
18	603019	中科曙光	19,669,789.87	755.63
19	601988	中国银行	19,340,200.00	742.96
20	300166	东方国信	19,219,437.84	738.33

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。

8.1.4.3 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	1,737,683,027.07
卖出股票的收入（成交）总额	1,638,318,082.58

8.1.5 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。

8.1.6 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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

8.1.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.1.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末无权证投资。

8.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同无投资股指期货的投资政策。

8.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.10.1 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。

8.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.1.11 本报告期投资基金情况

8.1.11.1 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。

8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 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。

8.1.12.2 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之外的股票。

8.1.12.3 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	348,293.29
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,196.96
5	应收申购款	243.65
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	349,733.90

8.1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券明细。

8.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.2 新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

8.2.1 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

8.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.2.3 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

本基金本报告期末无股票投资。

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.4.1 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	002697	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。

8.2.4.2 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