新华优选分红混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:二〇一九年三月二十八日

§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2019年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华优选分红混合	
基金主代码	519087	
交易代码	519087(前端)	519088(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年9月16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	1,303,999,772.06份	

2.2 基金产品说明

投资目标	有效地控制风险,实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准并提供稳定的分红。
投资策略	采用战术型资产配置策略;寻找品质优异的高成长型上市公司及分红能力强的价值型上市公司,并辅助以国际竞争力比较,寻找具有市场估值洼地的股票,确定最终的投资组合。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+40%×上证国债指数
风险收益特征	本基金属于中等风险的混合型基金,其风险收益特征从长期平均来看,介于股票基金与债券基金之间。

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	齐园	贺倩
	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

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-42,184,358.76	-1,342,658.76	-182,986,162.48
本期利润	-248,183,066.06	91,913,575.61	-234,072,907.42
加权平均基金份额本期利润	-0.1796	0.0594	-0.1364
本期基金份额净值增长率	-22.37%	8.78%	-15.46%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0019	0.1766	0.1123
期末基金资产净值	808,122,751.08	1,127,081,867.56	1,203,874,887.48
期末基金份额净值	0.6197	0.7983	0.7339

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与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
过去三个月	-10.71%	1.85%	-6.823%	0.98%	-3.88%	0.87%
过去六个月	-21.34%	1.71%	-7.52%	0.90%	-13.82%	0.81%
过去一年	-22.37%	1.57%	-13.74%	0.80%	-8.63%	0.77%
过去三年	-21.61%	1.16%	-7.54%	0.71%	-21.07%	0.45%
过去五年	22.35%	1.40%	31.56%	0.92%	-9.21%	0.48%
自基金合同生效起至今	362.20%	1.50%	175.43%	1.05%	186.77%	0.45%

注:1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深300指数,债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数,复利业绩比较基准为60%×沪深300指数+40%×上证国债指数。

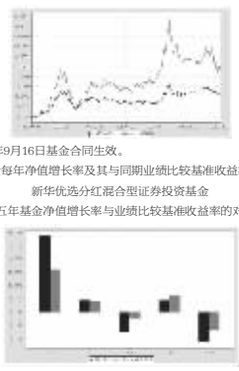
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华优选分红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的历史走势对比图

(2005年9月16日至2018年12月31日)



注:本基金于2005年9月16日基金合同生效。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华优选分红混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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12月31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、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、新华安享惠钰定期开放债券型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债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		
赵强	本基金基金经理,权益投资部总监,新华策略精选股票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、买大基金基金经理、中欧基金投资经理。

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优选分红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》、《新华优选分红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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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于方的交易,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 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定基金管理人对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内以及5日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明:债券同向交易频率偏低;股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断,即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大,结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生,本报告期内,未发生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年是中国证券市场跌宕起伏的一年,全年受严监管政策、经济下行预期、中美贸易摩擦等不利因素影响,投资者风险偏好大幅降低,市场一路震荡下行,所有板块无一幸免,都出现较大跌幅。不过值得欣慰的是,在四季度,中美两国领导人G20峰会上达成共识,开始着手解决出现的贸易摩擦,近期也取得了良好的进展。改革开放四十周年,政府加大了改革和开放力度,开始降税减费等实质改革措施。在去年底的中央经济工作会议上,宏观政策开始进行逆周期调节,政策明显转向,资金面开始宽松,抵消了大家对经济进一步下跌的悲观预期,因此市场在2019年一季度出现了较大的反弹。

在2018年全年,本基金仓位波动不大,继续保持中高仓位。虽然我们也预期到了短期的风险,但是并没有大幅减仓,导致短期净值带来了一定的损失,因为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,并取得良好的绝对回报。在优质公司受外在因素,短期价格下跌的时候,长期看正是逐渐买入的良好时机,而不是减仓的时机。我们坚信这种理念,并将持之以恒的坚持下去,也希望投资者给我们多一份耐心和信心。事实证明,在2019年一季度的反弹过程中,优质公司也基本收复了2018年的跌幅,回到了应有的价值上来。

在行业选择上,我们重点持有稳健成长的白马蓝筹股,主要是性价比比较明显、回报率较高,现金流优异的家电、食品饮料、地产、建材、高端制造等行业龙头。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、自由现金流良好、估值合理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,中长期持有,才能给股东创造真正的价值。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。特别是在2019年A股MSCI指数权重大幅提高,又加入了标普道琼斯指数,也即将加入富时罗素指数,外资将会持续大量流入,中国也会更加开放,外资将成为继公募基金、保险、社保等机构投资者之后,最重要的机构投资者,A股市场的估值和定价体系也必将逐渐与国际接轨。更值得关注的是,近期即将成立的科创板,试行注册制发行管理制度,未来将逐步扩展到整个主板市场,整个A股的生态和投资风格将会由于制度变化发生重大改变,这是值得高度关注的历史发展方向。未来A股从个人散户为主的投机市场向以机构为主的投资市场转变是必然趋势。因此,从长远眼光看,我们要以国际化的视野和标准去筛选公司,更加注重公司核心竞争力、财务状况和估值的分析。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,本基金份额净值为0.6197元,本报告期份额净值增长率为-22.37%,同期业绩比较基准的增长率为-13.74%。

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2019年,我们认为在宏观逆周期的对冲调控政策的带动下,中国经济有望逐渐触底企稳。股票市场在经历2018年大幅下跌的情况下,连续再大幅下跌的概率也不大。在2018年底,市场估值都处于历史低位,积蓄了反弹的动能。中美贸易摩擦的缓和和中国改革开放的进一步推进,也提振了投资者对未来的信心。因此,我们去年年底就对2019年的行情不悲观,或者说至少有结构性的机会,2019年一季度的大幅反弹,也印证了我们的判断和逻辑。我们认为2019年的恢复上涨是合理的,蓝筹的估值恢复,以及科技成长股在科创板即将成立,国家政策大力支持下出现的大涨,有一定的合理性。但是短期看,也有一点隐忧,近期业绩暴雷公司和一些次新题材公司也出现疯涨,明显是投机泡沫炒作,历史上泡沫破裂后的惨痛教训历历在目,我们要时刻铭记,坚决抵制。最后,我们还是要看清历史轨迹,看清未来方向,坚定价值投资,坚定信念,选择优质公司长期投资,努力为基金持有人创造真实的价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工

4.7.1.1 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、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。

4.7.1.2 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。

4.7.1.3 投资管理部的职责分工

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。

4.7.1.4 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因时回应;

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。

4.7.1.5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部问讯;

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形。

§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

在托管新华优选分红混合型证券投资基金的过程中,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,对新华优选分红混合型证券投资基金管理人——新华基金管理股份有限公司2018年1月1日至2018年12月31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新华优选分红混合型证券投资基金的投资运作、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、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新华优选分红混合型证券投资基金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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 张伟 胡慰签字出具了瑞华审字【2019】01360009号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:新华优选分红混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:	-	-
银行存款	112,200,196.92	54,594,157.39
结算备付金	489,065.06	3,164,194.29
存出保证金	580,193.20	1,213,971.64
交易性金融资产	773,378,511.78	1,053,733,388.35
其中:股票投资	692,127,511.78	949,667,705.95
基金投资	-	-
债券投资	81,251,000.00	104,065,679.40
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	10,000,000.00	20,000,000.00
应收证券清算款	4,674,345.64	2,720,065.49
应收利息	801,708.74	1,722,856.48
应收股利	-	-
应收申购款	105,947.01	97,708.69
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	902,229,968.34	1,137,246,339.33
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	8,267,942.92	-
应付赎回款	81,230,421.83	3,264,203.27
应付管理人报酬	1,157,861.67	1,413,015.52
应付托管费	192,976.93	235,502.57
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	906,280.62	2,950,877.61
应交税费	3.93	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,352,729.36	2,300,872.80
负债合计	94,107,217.26	10,164,471.77
所有者权益:	-	-
实收基金	810,638,673.59	877,700,757.87
未分配利润	-2,515,822.51	249,381,109.69
所有者权益合计	808,122,751.08	1,127,081,867.56
负债和所有者权益总计	902,229,968.34	1,137,246,339.33

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.6197元,基金份额1,303,999,772.05份。

7.2 利润表

会计主体:新华优选分红混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-224,548,493.76	121,139,361.84
1.利息收入	3,493,768.60	4,566,924.80
其中:存款利息收入	369,991.70	2,035,338.09
债券利息收入	3,070,717.05	680,083.24
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	63,059.25	1,840,503.47
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-22,305,193.13	23,225,578.57
其中:股票投资收益	-37,597,563.47	12,674,439.52
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,040,900.39	-
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	16,373,270.69	10,561,139.05
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-205,998,707.36	93,256,234.37
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	221,638.07	101,624.10
减:二、费用	23,634,572.30	29,225,798.23
1. 管理人报酬	15,544,925.13	16,958,581.78
2. 托管费	2,590,820.84	2,826,430.33
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,054,928.76	8,990,952.67
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	150.98	-
7. 其他费用	443,746.65	449,821.45
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-248,183,066.06	91,913,575.61
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-248,183,066.06	91,913,575.61

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华优选分红混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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)	877,700,757.87	249,381,109.69	1,127,081,867.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	-248,183,066.06	-248,183,066.06
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)	-67,062,184.28	-3,713,866.14	-70,776,050.42
其中:1.基金申购款	171,369,757.37	43,979,069.11	215,348,826.48
2.基金赎回款	-238,431,941.65	-47,692,935.25	-286,124,876.90
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)	810,638,573.59	-2,515,822.51	808,122,751.08

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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)	1,019,707,499.48	184,167,388.17	1,203,874,887.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	91,913,575.61	91,913,575.61
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)	-142,006,741.61	-26,499,864.09	-168,706,605.70
其中:1.基金申购款	45,773,627.18	7,904,010.28	53,677,637.57
2.基金赎回款	-187,780,368.79	-34,603,874.48	-222,384,243.27
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)	877,700,757.87	249,381,109.69	1,127,081,867.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华优选分红混合型证券投资基金(以下简称"本基金")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[2005]第115号《关于核准新世纪优选分红混合型证券投资基金募集的批复》核准,由新华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新华优选分红混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集资金总额618,416,866.55元,业经重庆天健会计师事务所重天健验【2005】第26号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《新华优选分红混合型证券投资基金基金合同》于2005年9月16日正式生效。本基金的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《中华人民共和国证券投资基金法》和《新华优选分红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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围是:股票投资比例为基金资产净值的20%--90%;债券及短期金融工具的投资比例为基金资产净值10%--80%。其中本基金实时持有的现金和到期日在一年以内的政府债券的合计比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为60%×沪深300指数+40%×上证国债指数。

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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制,根据实际发生的交易和事项,按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华优选分红混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度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12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

7.4.6 税项

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。

7.4.7 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
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
杭州水原网络科技有限公司	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
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
北京新华丽时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31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	406,209,792.46	11.33%	425,679,165.46	6.65%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	3,552,911.40	26.08%	-	-

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	-	-	290,000,000.00	11.86%

7.4.8.1.5 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	359,652.69	12.27%	31,331.82	3.46%
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	381,087.13	7.21%	32,035.78	1.09%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	15,544,925.13	16,958,581.78
其中:支付销售机构的客户维护费	2,974,111.85	3,354,054.35

注:基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提确认。计算公式为:

每日基金管理费=前一日基金资产净值×(1.5%÷当年天数)

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	2,590,820.84	2,826,430.33

注:基金托管费按前一日的基金资产净值2.5‰的年费率逐日计提确认。计算公式为

每日基金托管费=前一日基金资产净值×(2.5‰÷当年天数)

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.