

新华中证环保产业指数分级证券投资基金

2017年第四个季度报告

基金管理人的董事、监事及董事会全体成员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、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1月9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。

基金管理人的董事、监事及董事会全体成员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金的投资目标：投资人风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 新华中证环保产业指数分级证券投资基金

基金代码 164304

交易代码 164304

基金运作方式 约定期开放式

基金合同生效日 2014年9月11日

报告期末基金份额总额 178,990,139.27份

基金资产净值 1,033元

基金份额净值 1,033元

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

基金类别 股票型

基金投资目标 本基金通过量化选股，精选具有高成长性、较高盈利能力的公司，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。

基金业绩基准 中证环保产业指数收益率×5%+商业银行同期存款利率(税后)

风险收益特征 高风险、高收益

基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与同期业绩比较基准收益率的变化情况

注：本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率的变化情况

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期 2017年10月1日-2017年12月31日

1.本期已实现收益 5,293,094.36

2.本期利润 -13,013,439.76

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0711

4.期末基金资产净值 195,622,294.52

5.期末基金份额净值 1.093

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.21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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.22基金净值表现

3.221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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.23基金净值表现

3.231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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.24基金净值表现

3.241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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.25基金净值表现

3.251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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.26基金净值表现

3.261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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.27基金净值表现

3.271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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.28基金净值表现

3.281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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.29基金净值表现

3.291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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.30基金净值表现

3.301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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.31基金净值表现

3.311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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.32基金净值表现

3.321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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.33基金净值表现

3.331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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.34基金净值表现

3.341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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.35基金净值表现

3.351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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.36基金净值表现

3.361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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.37基金净值表现

3.371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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.38基金净值表现

3.381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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.39基金净值表现

3.391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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.40基金净值表现

3.401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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.41基金净值表现

3.411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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.42基金净值表现

3.421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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.43基金净值表现

3.431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

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（例如基金申购赎回费等），费用影响实际收益水平要低于所列数字。

3.44基金净值表现

3.441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

注：1.本期已实现收益指