

## 2018年1月20日 星期六

本报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

**5.115 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末本基金前十名股票不存在流通受限的情况。

516 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            |
|-----------------|------------------|
| 本报告期初基金份额总额     | 484, 079, 178.14 |
| 报告期内基金总申购份额     | 169, 897.13      |
| 减: 报告期内基金总赎回份额  | 61, 904, 713.56  |
| 减: 报告期内基金拆分变动份额 | -                |
| 本报告期末基金份额总额     | 422, 344, 361.69 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

713 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

72 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额的<br>股数   | 持有份额占基<br>金总份额比例 | 发起份额总<br>股数   | 发起份额占基<br>金总份额比例 | 发起份额未持有<br>期限 |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|---------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,400.04 | 2.37%            | 10,000,400.04 | 2.37%            | 3年            |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                | -             | -                | -             |
| 基金经理等人员     | -             | -                | -             | -                | -             |
| 基金管理人股东     | -             | -                | -             | -                | -             |
| 其他          | -             | -                | -             | -                | -             |
| 合计          | 10,000,400.04 | 2.37%            | 10,000,400.04 | 2.37%            | 3年            |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

91 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华稳盈回报灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华稳盈回报灵活配置混合型发起式证券投资基金之法律意见书

(三)《新华稳盈回报灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

(四)《新华稳盈回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

(五)《新华基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(六)更新的《新华稳盈回报灵活配置混合型发起式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、变更住所的公告

**2. 2 存放地点**  
基金管理人、基金托管人住所。

**2. 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,或通过本基金管理有限公司官网查阅。

新华基金管理股份有限公司  
二〇一八年一月二十日

[illegible]

|   |         |            |
|---|---------|------------|
| 1 | 存出保证金   | 83,486.58  |
| 2 | 应收证券清算款 | 254,572.54 |
| 3 | 应收股利    | -          |
| 4 | 应收利息    | 20,505.72  |
| 5 | 应收申购款   | 6,154.04   |
| 6 | 其他应收款   | -          |
| 7 | 待摊费用    | -          |
| 8 | 其他      | -          |
| 9 | 合计      | 364,718.88 |

514 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。

515 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 名称     | 单位   | 数量           | 金额(元) | 比例(%)            | 说明 |
|----|--------|------|--------------|-------|------------------|----|
| 1  | 600039 | 万华化学 | 5,235,720.00 | 10.07 | 募集资金投资于<br>股票的投资 |    |
| 2  | 600332 | 白云山  | 1,954,112.00 | 3.76  | 募集资金投资于<br>股票    |    |

5 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,以上基金资产净值之和可能存在尾差;

§ 6 开放式基金份额变动

|               | 单位:份          |
|---------------|---------------|
| 本报告期期初的基金份额总额 | 92,065,028.72 |
| 报告期内基金总申购份额   | 755,796.01    |
| 减:报告期内基金总赎回份额 | 45,508,457.37 |
| 报告期内基金净申购份额   | 47,309,365.03 |
| 本报告期期末基金份额总额  | 47,309,365.03 |

§ 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

| 报告期内持有基金净值变动情况 |    |                               |               |      |               | 报告期末持有基金信息 |       |
|----------------|----|-------------------------------|---------------|------|---------------|------------|-------|
| 投资者类别          | 序号 | 持有基金份额时间<br>连续或者累计≥20%<br>的期间 | 期初份额          | 本期申购 | 赎回份额          | 持有份额       | 份额占比  |
| 机构             | 1  | 2017/10/10-2017/12/14         | 26,999,000.00 | 0.00 | 26,999,000.00 | 0.00       | 0.00% |
|                |    |                               | 产生资产增值        |      |               |            |       |

**81 跟踪偏离度及原因**

1. 跟踪偏离度的绝对值超过基金合同规定的跟踪误差，中小投资者可能面临跟踪偏离度风险；跟踪误差过大，中小投资者可能面临跟踪误差扩大的风险。

2. 本基金存在跟踪偏离的风险。当管理人进行基金财产运作时可能出现对基金资产净值造成较大波动；

3. 管理人对基金净值的估值错误；

4. 机构投资者申购、赎回造成基金资产净值增加或减少 5000 万元的情况，若连续十个工作日出现基金资产净值增加或减少 5000 万元的情况，可能导致基金资产净值波动加大，基金财产运作进行调整；

4. 本基金跟踪中小投资者的风险

机构投资者申购、赎回导致基金净值波动大，本基金可能面临跟踪投资回报滞后、交易价格与交易所交易的价格不一致等风险。

**82 影响投资策略实施的其他重要因素**

本报告期内本基金未有影响投资策略实施的其他重要因素。

**§ 9 备查文件目录**

**91 备查文件目录**

(一)中国证监会批准新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(三)新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议

(四) 新科创投资新主题双驱动混合型证券投资基金基金合同  
(五) 新科创基金资产净值公告、基金招募说明书及基金产品资料概要  
(六) 更新的《新科创技术创新主题双驱动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) 中国证监会要求的其他文件

**92 存放地点**  
基金管理人、基金托管人住所。

**93 查阅方式**  
投资者可免费查阅，营业时间内亦可按工本费购买复印件，或访问本基金管理人网站查阅。

新华基金管理有限公司  
二〇一八年一月二十日

本基金合同尚无国债期货投资政策。  
**5.02** 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。  
**5.1** 投资组合报告附注

截至前一年度收到公开谴责、处罚的情形

5.12 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

5.13 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 61,648.20    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,827,509.19 |
| 3  | 应收股利    |              |
| 4  | 应收利息    | 2,207.12     |
| 5  | 应收申购款   | 11,576.84    |
| 6  | 其他应收款   |              |
| 7  | 待摊费用    |              |
| 8  | 其他      |              |
| 9  | 合计      | 1,903,139.35 |

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金无处于转股期的可转换债券

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票不存在流通受限的情况

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于组合五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在误差。

| 单位:元          |                |
|---------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额   | 263,666,661.67 |
| 报告期末基金已申购份额   | 1,323,602.06   |
| 截至报告期末基金赎回的份额 | 91,404,696.39  |
| 报告期末基金份额总额    | 69,989,967.34  |
| 本报告期末基金份额总额   | 173,565,567.34 |

(六)更新的《新华积极价值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  
**92** 存放地点  
基金管理人、基金托管人住所。  
**93** 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  
二〇一八年一月二十日

---