

**新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金**  
**2019 年半年度报告**  
**2019 年 6 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 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。本半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 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	错误!未定义书签。
2.2 基金产品说明.....	错误!未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人.....	错误!未定义书签。
2.4 信息披露方式.....	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	错误!未定义书签。
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	错误!未定义书签。
3.2 基金净值表现.....	错误!未定义书签。
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	错误!未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	错误!未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	错误!未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	错误!未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	错误!未定义书签。
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	错误!未定义书签。
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	错误!未定义书签。
6.2 利润表.....	错误!未定义书签。
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	错误!未定义书签。
6.4 报表附注.....	错误!未定义书签。
<b>7 投资组合报告</b> .....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	错误!未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	错误!未定义书签。
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.5 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	错误!未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	错误!未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	错误!未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.13 投资组合报告附注.....	错误!未定义书签。
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	错误!未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	错误!未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	错误!未定义书签。
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	错误!未定义书签。
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变.....	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	错误!未定义书签。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	错误!未定义书签。
10.8 其他重大事件.....	错误!未定义书签。
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录.....	错误!未定义书签。
12.2 存放地点.....	错误!未定义书签。
12.3 查阅方式.....	错误!未定义书签。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型指数
基金主代码	512920
交易代码	512920
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 7 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	13,092,640.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略及融资及转融通证券出借。 本基金采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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	姓名	齐岩	贺倩

负责人	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
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		400010	100031
法定代表人		陈重	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	3,248,260.32
本期利润	12,433,777.46
加权平均基金份额本期利润	0.3911
本期加权平均净值利润率	37.60%
本期基金份额净值增长率	28.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	2,144,526.11
期末可供分配基金份额利润	0.1638
期末基金资产净值	15,704,976.17
期末基金份额净值	1.1995
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	19.95%

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、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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金基金合同于 2018 年 11 月 07 日生效，截止报告期末未满一年。

### 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
过去一个月	5.10%	1.16%	4.54%	1.16%	0.56%	0.00%
过去三个月	-1.50%	1.51%	-2.36%	1.51%	0.86%	0.00%
过去六个月	28.17%	1.51%	25.08%	1.52%	3.09%	-0.01%
自基金合同生效起至今	19.95%	1.35%	17.76%	1.44%	2.19%	-0.09%

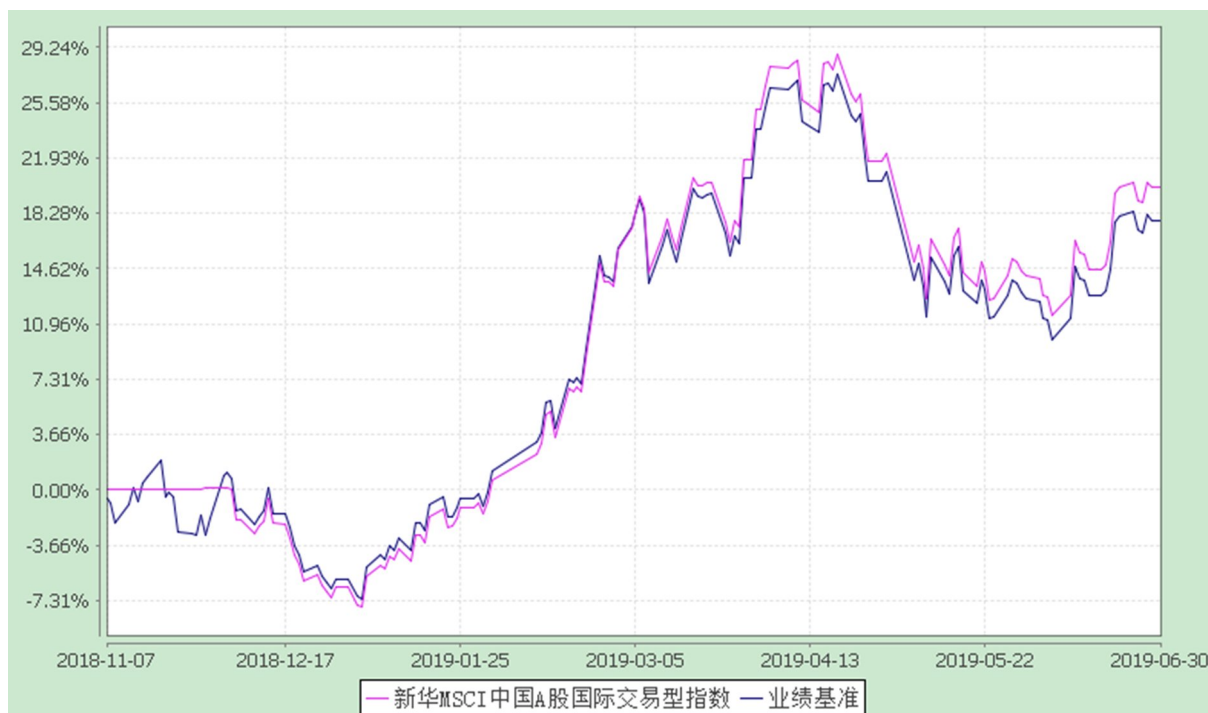
注：1、本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、本基金于 2018 年 11 月 07 日基金合同生效，报告截止 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2018 年 11 月 7 日至 2019 年 6 月 30 日）



注：1、本基金于 2018 年 11 月 07 日基金合同生效，报告截止 2019 年 06 月 30 日未满一年。  
2、本报告期末本基金各项资产配置比例符合合同约定。

## 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 2019 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十四只开放式基金，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、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、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、新华家盈双利混合型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金和新华鼎利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		
邓岳	本基金基金经理，新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理、新华华丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2018-11-07	-	11	信息与信号处理专业硕士,历任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员,国信证券股份有限公司量化研究员,光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理,盈融达投资(北京)有限公司投资经理。
林心龙	本基金基金经理助理。	2019-06-19	-	4	工学硕士,历任南方基金交易算法研究员,量化研究员,高级量化研究员。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数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

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。

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

本基金为指数基金，以对标的指数的有效跟踪为投资目标。

2019 年上半年，本基金采用完全复制的被动式指数投资方法，避免不必要的交易，产品紧密跟踪了指数的走势，保持了较小的跟踪误差。报告期内，标的指数发生两次成分股调整，本基金根据

成份股及其权重的变动，在有效地控制了跟踪误差的情况下，平稳地完成了调整。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2018 年 11 月 07 日基金合同生效，报告截止 2019 年 06 月 30 日未满一年。截至 2019 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 1.1995 元，本报告期份额净值增长率为 28.17%，同期比较基准的增长率为 25.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来本基金将延续同样的被动投资策略，紧跟标的指数，争取维持与指数较小的偏离度。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

##### 一、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、投资管理部门、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。

##### 二、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门相互独立。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。

### 三、投资管理部门的职责分工

- 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。

### 四、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即时回应；
- 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。

### 五、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管理部门问讯；
- 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

本基金于 2018 年 11 月 07 日基金合同生效，报告截止 2019 年 06 月 30 日未满一年。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

本报告期本基金从 2019 年 02 月 11 日至 2019 年 06 月 30 日连续 95 个交易日基金资产净值低于

五千万。

## 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

在托管本基金的过程中,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,对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 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本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,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 托管人对本半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本基金半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	367,312.41	2,590,698.81
结算备付金		12,943.39	324.92
存出保证金		110,921.80	8.99

交易性金融资产	6.4.7.2	15,595,897.14	105,571,558.71
其中：股票投资		15,595,897.14	105,571,558.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	111.94	529.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>16,087,186.68</b>	<b>108,163,120.94</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		-	-
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		90,354.19	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,234.96	69,370.32
应付托管费		1,247.02	13,874.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	175,645.84	213,711.01
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,728.50	156,542.44
<b>负债合计</b>		<b>382,210.51</b>	<b>453,497.81</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	13,092,640.00	115,092,640.00
未分配利润	6.4.7.10	2,612,336.17	-7,383,016.87
<b>所有者权益合计</b>		<b>15,704,976.17</b>	<b>107,709,623.13</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>16,087,186.68</b>	<b>108,163,120.94</b>

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年，基金份额净值 1.1995 元，基金份额总额 13,092,640.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>12,719,064.31</b>
1.利息收入		8,402.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,402.33
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,383,271.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,216,776.63
基金投资收益		-
债券投资收益		-
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	6.4.7.17	166,494.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	9,185,517.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	141,873.40
<b>减：二、费用</b>		<b>285,286.85</b>
1. 管理人报酬		84,187.62
2. 托管费		16,837.59
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	62,805.45
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.21	121,456.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>12,433,777.46</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>12,433,777.46</b>

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	115,092,640.00	-7,383,016.87	107,709,623.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,433,777.46	12,433,777.46
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）	-102,000,000.00	-2,438,424.42	-104,438,424.42
其中：1.基金申购款	3,000,000.00	-170,292.81	2,829,707.19
2.基金赎回款	-105,000,000.00	-2,268,131.61	-107,268,131.61
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）	13,092,640.00	2,612,336.17	15,704,976.17

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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：刘全胜，会计机构负责人：徐端骞

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系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【2018】1019 号文《关于准予新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册募集，由新华基金管理股份有限公司发起募集的交易型开放式指数证券投资基金，存续期不限定。于 2018 年 09 月 26 日通过网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式公开发售，发行期限：2018 年 09 月 26 日至 2018 年 10 月 31 日。首次募集资金总额 280,092,640.00 元，其中募集资金产生利息 73,260.06 元，并经瑞华会计师



事务所瑞华验字[2018]第 01360026 号验资报告予以验证。2018 年 11 月 07 日办理基金备案手续,基金合同正式生效。申请发行基金募集份额不少于 2 亿份,本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《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以在履行适当程序后,参与融资及转融通证券出借业务。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,本基金可将其纳入投资范围,其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数。

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 8 月 23 日批准报出。

#### 6.4.2 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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的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财务状况、经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 2019 年 1 月 1 日起至 06 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 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。

#### 6.4.4.4 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。

### 6.4.4.5 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。

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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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）。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提；

(3) 基金指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.0125% 季费率计提，每季度最低支付 5000 美金；

(4) 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；

(5) 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四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金管理人对于基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；

2、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

3、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采取现金分红方式；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	367,312.41
定期存款	-
其他存款	-
合计	367,312.41

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,612,723.49	15,595,897.14	1,983,173.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	13,612,723.49	15,595,897.14	1,983,173.65

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

- 1、本报告期末本基金无衍生金融资产/负债。
- 2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

- 1、本报告期末本基金无买入返售金融资产。
- 2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

- 1、本报告期末本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。
- 2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	61.81
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	50.13
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	111.94

注：1、应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.6 其他资产

1、本基金本报告期末无其他资产。

2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	175,645.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	175,645.84

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	1,952.45
预提费用	106,776.05
合计	108,728.50

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	115,092,640.00	115,092,640.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00

本期赎回（以“-”号填列）	-105,000,000.00	-105,000,000.00
本期末	13,092,640.00	13,092,640.00

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,346,130.71	-5,036,886.16	-7,383,016.87
本期利润	3,248,260.32	9,185,517.14	12,433,777.46
本期基金份额交易产生的变动数	1,242,396.50	-3,680,820.92	-2,438,424.42
其中：基金申购款	-68,393.27	-101,899.54	-170,292.81
基金赎回款	1,310,789.77	-3,578,921.38	-2,268,131.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,144,526.11	467,810.06	2,612,336.17

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,464.60
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,937.73
其他	-
合计	8,402.33

注：1、结算备付金利息收入包含结算保证金利息收入。

2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,773,221.04
股票投资收益——赎回差价收入	1,443,555.59
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	3,216,776.63

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	38,923,708.31
减：卖出股票成本总额	37,150,487.27
买卖股票差价收入	1,773,221.04

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	107,268,131.61
减：现金支付赎回款总额	31,035,420.61
减：赎回股票成本总额	74,789,155.41
赎回差价收入	1,443,555.59

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本报告期无申购差价收入。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

- 1、本基金本报告期内无债券投资。
- 2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

- 1、本基金本报告期内无资产支持证券投资。
- 2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

- 1、本基金本报告期内无贵金属投资。
- 2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

- 1、本基金本报告期内无衍生工具投资。
- 2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	166,494.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	166,494.81

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	9,185,517.14
——股票投资	9,185,517.14
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	9,185,517.14

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	141,873.40
合计	141,873.40

注：1、替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际

买入成本与申购日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	62,805.45
银行间市场交易费用	-
合计	62,805.45

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	67,104.47
汇划手续费	1,732.05
指数使用费	12,948.09
其他	-
合计	121,456.19

注：1、指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.0125% 的季费率计提，逐日累计至每个季度季末，按季支付。基金合同生效日所在季度的指数使用费，根据实际天数按比例收取。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数许可使用费的收取下限为每季度 5000 美金。

2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。截至 2019 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。截至财务报告签

发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
中国农业银行股份有限公司	基金托管人

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	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	339,283.66	0.69%

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金本报告期内未通过关联交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金本报告期内未通过关联交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金本报告期内未通过关联交易单元进行债券回购交易。



**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30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	273.15	1.40%	273.15	0.16%

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	84,187.62
其中：支付销售机构的客户维护费	6,842.21

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 × (0.50% ÷ 当年天数)

2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,837.59

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法为：每日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% ÷ 当年天数。

2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金本报告期内未发生关联方销售服务费。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	367,312.41	2,464.71

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

#### 6.4.10.5 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.5.1 其他关联交易事项的说明

2019 年 06 月 30 日，本基金持有 45,800 股中国农业银行股份有限公司的 A 股普通股，成本额为人民币 165526.28 元，估值总额为人民币 164880.00 元，占基金资产净值的比例为 1.05%。

##### 6.4.10.5.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金本报告期未持有本基金管理人以及管理人关联方所管理基金。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截至 2017 年 12 月 31 日止无收益分配事项。

#### 6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金期末未持有因认购新发/增发流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金期末未持有银行间市场债券正回购。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金期末未持有交易所市场债券正回购。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折

现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

##### 6.4.13.4.2 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 6.4.13.4.2.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	367,312.41	-	-	-	367,312.41
结算备付金	12,943.39	-	-	-	12,943.39
存出保证金	110,921.80	-	-	-	110,921.80
交易性金融资产	-	-	-	15,595,897.14	15,595,897.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	111.94	111.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	491,177.60	-	-	15,596,009.08	16,087,186.68
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	-	-	-	90,354.19	90,354.19
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	6,234.96	6,234.96
应付托管费	-	-	-	1,247.02	1,247.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	175,645.84	175,645.84
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	108,728.50	108,728.50
负债总计	-	-	-	382,210.51	382,210.51
利率敏感度缺口	491,177.60	-	-	15,213,798.57	15,704,976.17
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,590,698.81	-	-	-	2,590,698.81
结算备付金	324.92	-	-	-	324.92
存出保证金	8.99	-	-	-	8.99
交易性金融资产	-	-	-	105,571,558.71	105,571,558.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	529.51	529.51
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	2,591,032.72	-	-	105,572,088.22	108,163,120.94
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	69,370.32	69,370.32
应付托管费	-	-	-	13,874.04	13,874.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	213,711.01	213,711.01
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	156,542.44	156,542.44
负债总计	-	-	-	453,497.81	453,497.81
利率敏感度缺口	2,591,032.72	-	-	105,118,590.41	107,709,623.13

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.2.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点；		
	其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	增加约 0	增加约 0
市场利率下降 25.00 bp	增加约 0	增加约 0	

注：本基金管理人运用 XRisk Suite 风险控制系统对本基金投资组合中的银行存款、结算备付金、存出保证金和债券类资产做出以上利率风险的敏感性分析。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	15,595,897.14	99.31	105,571,558.71	98.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,595,897.14	99.31	105,571,558.71	98.01

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升 1%			其他市场变量不变,沪深 300 指数下降 1%		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)				
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	沪深 300 指数上升 1%	增加约 15	增加约 106			
	沪深 300 指数下降 1%	减少约 15	减少约 106			

注：本基金管理人运用 XRisk suite 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价

格风险的敏感性分析。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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	15,595,897.14	96.95
	其中：股票	15,595,897.14	96.95
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	380,255.80	2.36
8	其他各项资产	111,033.74	0.69
9	合计	16,087,186.68	100.00

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	206,242.00	1.31
B	采矿业		



		557,809.87	3.55
C	制造业	6,775,619.85	43.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	435,505.03	2.77
E	建筑业	395,935.00	2.52
F	批发和零售业	339,789.91	2.16
G	交通运输、仓储和邮政业	490,161.00	3.12
H	住宿和餐饮业	18,719.40	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	762,318.44	4.85
J	金融业	4,360,747.11	27.77
K	房地产业	777,530.80	4.95
L	租赁和商务服务业	198,977.00	1.27
M	科学研究和技术服务业	11,408.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	25,412.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	99,693.73	0.63
R	文化、体育和娱乐业	96,850.00	0.62
S	综合	43,178.00	0.27
	合计	15,595,897.14	99.31

注：本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金于 2018 年 11 月 07 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	800	787,200.00	5.01
2	601318	中国平安	6,700	593,687.00	3.78
3	600036	招商银行	12,700	456,946.00	2.91
4	000858	五粮液	2,400	283,080.00	1.80

5	601166	兴业银行	12,800	234,112.00	1.49
6	600000	浦发银行	18,030	210,590.40	1.34
7	601398	工商银行	33,200	195,548.00	1.25
8	600276	恒瑞医药	2,680	176,880.00	1.13
9	000002	万科A	6,000	166,860.00	1.06
10	601288	农业银行	45,800	164,880.00	1.05
11	600900	长江电力	9,000	161,100.00	1.03
12	002415	海康威视	5,737	158,226.46	1.01
13	601668	中国建筑	25,800	148,350.00	0.94
14	601328	交通银行	24,100	147,492.00	0.94
15	603288	海天味业	1,400	147,000.00	0.94
16	000001	平安银行	10,600	146,068.00	0.93
17	600030	中信证券	6,100	145,241.00	0.92
18	601601	中国太保	3,900	142,389.00	0.91
19	600016	民生银行	21,800	138,430.00	0.88
20	600887	伊利股份	3,700	123,617.00	0.79
21	600104	上汽集团	4,800	122,400.00	0.78
22	601766	中国中车	15,000	121,350.00	0.77
23	600050	中国联通	19,100	117,656.00	0.75
24	300498	温氏股份	3,200	114,752.00	0.73
25	002304	洋河股份	900	109,404.00	0.70
26	000333	美的集团	2,100	108,906.00	0.69
27	601888	中国国旅	1,200	106,380.00	0.68
28	600585	海螺水泥	2,500	103,750.00	0.66
29	000651	格力电器	1,800	99,000.00	0.63
30	601818	光大银行	24,500	93,345.00	0.59
31	600048	保利地产	7,300	93,148.00	0.59
32	601688	华泰证券	4,000	89,280.00	0.57
33	600028	中国石化	15,700	85,879.00	0.55
34	001979	招商蛇口	4,100	85,690.00	0.55
35	601211	国泰君安	4,600	84,410.00	0.54
36	601988	中国银行	21,400	80,036.00	0.51
37	601229	上海银行	6,700	79,395.00	0.51
38	601989	中国重工	14,100	78,396.00	0.50
39	002142	宁波银行	3,200	77,568.00	0.49
40	601169	北京银行	12,900	76,239.00	0.49
41	600019	宝钢股份	11,300	73,450.00	0.47
42	601006	大秦铁路	9,000	72,810.00	0.46
43	000568	泸州老窖	900	72,747.00	0.46
44	601336	新华保险	1,300	71,539.00	0.46
45	600837	海通证券	5,000	70,950.00	0.45
46	000725	京东方A	20,600	70,864.00	0.45
47	601186	中国铁建	7,000	69,650.00	0.44
48	601857	中国石油	10,000	68,800.00	0.44

49	000063	中兴通讯	2,100	68,313.00	0.43
50	600690	青岛海尔	3,800	65,702.00	0.42
51	002024	苏宁易购	5,700	65,436.00	0.42
52	600031	三一重工	4,800	62,784.00	0.40
53	002475	立讯精密	2,500	61,975.00	0.39
54	601933	永辉超市	5,900	60,239.00	0.38
55	600015	华夏银行	7,800	60,060.00	0.38
56	600999	招商证券	3,500	59,815.00	0.38
57	600340	华夏幸福	1,800	58,626.00	0.37
58	000166	申万宏源	11,600	58,116.00	0.37
59	002594	比亚迪	1,100	55,792.00	0.36
60	601155	新城控股	1,400	55,734.00	0.35
61	601088	中国神华	2,700	55,026.00	0.35
62	300059	东方财富	4,000	54,200.00	0.35
63	300015	爱尔眼科	1,709	52,927.73	0.34
64	002714	牧原股份	900	52,911.00	0.34
65	601012	隆基股份	2,270	52,459.70	0.33
66	600406	国电南瑞	2,800	52,192.00	0.33
67	600919	江苏银行	7,000	50,820.00	0.32
68	600009	上海机场	600	50,268.00	0.32
69	000538	云南白药	600	50,052.00	0.32
70	000776	广发证券	3,600	49,464.00	0.31
71	601628	中国人寿	1,700	48,144.00	0.31
72	601225	陕西煤业	5,100	47,124.00	0.30
73	002027	分众传媒	8,900	47,081.00	0.30
74	600010	宝钢股份	27,700	46,813.00	0.30
75	600436	片仔癀	400	46,080.00	0.29
76	000338	潍柴动力	3,700	45,473.00	0.29
77	600547	山东黄金	1,101	45,328.17	0.29
78	000876	新希望	2,600	45,162.00	0.29
79	601985	中国核电	7,900	43,924.00	0.28
80	002230	科大讯飞	1,300	43,212.00	0.28
81	601939	建设银行	5,800	43,152.00	0.27
82	601009	南京银行	5,200	42,952.00	0.27
83	603993	洛阳钼业	10,700	42,372.00	0.27
84	000895	双汇发展	1,700	42,313.00	0.27
85	601669	中国电建	7,800	41,262.00	0.26
86	600741	华域汽车	1,900	41,040.00	0.26
87	600029	南方航空	5,200	40,144.00	0.26
88	600588	用友网络	1,490	40,051.20	0.26
89	601899	紫金矿业	10,500	39,585.00	0.25
90	600958	东方证券	3,700	39,516.00	0.25
91	600115	东方航空	6,000	37,620.00	0.24
92	600332	白云山	900	36,873.00	0.23

93	601901	方正证券	5,000	35,550.00	0.23
94	600018	上港集团	5,200	35,464.00	0.23
95	600570	恒生电子	520	35,438.00	0.23
96	000069	华侨城 A	5,000	34,750.00	0.22
97	600809	山西汾酒	500	34,525.00	0.22
98	300122	智飞生物	800	34,480.00	0.22
99	000661	长春高新	100	33,800.00	0.22
100	600438	通威股份	2,400	33,744.00	0.21
101	600606	绿地控股	4,900	33,467.00	0.21
102	600383	金地集团	2,800	33,404.00	0.21
103	601618	中国中冶	10,900	33,136.00	0.21
104	002736	国信证券	2,500	32,900.00	0.21
105	300760	迈瑞医疗	200	32,640.00	0.21
106	600886	国投电力	4,100	31,857.00	0.20
107	600893	航发动力	1,400	31,794.00	0.20
108	600352	浙江龙盛	2,000	31,540.00	0.20
109	601600	中国铝业	8,000	31,360.00	0.20
110	002311	海大集团	1,000	30,900.00	0.20
111	600061	国投资本	2,200	30,822.00	0.20
112	600795	国电电力	12,000	30,480.00	0.19
113	600196	复星医药	1,200	30,360.00	0.19
114	601877	正泰电器	1,300	30,017.00	0.19
115	600705	中航资本	5,500	29,810.00	0.19
116	300033	同花顺	300	29,508.00	0.19
117	601138	工业富联	2,400	28,920.00	0.18
118	600111	北方稀土	2,200	28,248.00	0.18
119	600703	三安光电	2,500	28,200.00	0.18
120	000963	华东医药	1,080	28,036.80	0.18
121	601377	兴业证券	4,100	27,634.00	0.18
122	300750	宁德时代	400	27,552.00	0.18
123	600516	方大炭素	2,239	27,517.31	0.18
124	002007	华兰生物	900	27,441.00	0.17
125	601788	光大证券	2,400	27,408.00	0.17
126	000100	TCL 集团	8,200	27,306.00	0.17
127	600660	福耀玻璃	1,200	27,276.00	0.17
128	601021	春秋航空	600	27,000.00	0.17
129	002202	金风科技	2,161	26,861.23	0.17
130	000768	中航飞机	1,700	26,775.00	0.17
131	002422	科伦药业	900	26,757.00	0.17
132	000783	长江证券	3,400	26,554.00	0.17
133	603899	晨光文具	600	26,382.00	0.17
134	002236	大华股份	1,811	26,295.72	0.17
135	600482	中国动力	1,100	25,982.00	0.17
136	601727	上海电气	4,800	25,824.00	0.16

137	600926	杭州银行	3,100	25,823.00	0.16
138	603589	口子窖	400	25,768.00	0.16
139	300142	沃森生物	900	25,524.00	0.16
140	600271	航天信息	1,100	25,355.00	0.16
141	300003	乐普医疗	1,100	25,322.00	0.16
142	002001	新 和 成	1,300	25,077.00	0.16
143	002157	正邦科技	1,500	24,990.00	0.16
144	002916	深南电路	240	24,460.80	0.16
145	002146	荣盛发展	2,600	24,414.00	0.16
146	600023	浙能电力	5,500	24,310.00	0.15
147	601108	财通证券	2,200	24,156.00	0.15
148	600674	川投能源	2,700	24,030.00	0.15
149	002352	顺丰控股	700	23,772.00	0.15
150	000596	古井贡酒	200	23,702.00	0.15
151	600004	白云机场	1,300	23,660.00	0.15
152	002044	美年健康	1,900	23,636.00	0.15
153	000157	中联重科	3,900	23,439.00	0.15
154	600346	恒力石化	1,920	23,347.20	0.15
155	601018	宁波港	5,300	23,267.00	0.15
156	000703	恒逸石化	1,700	23,222.00	0.15
157	600085	同仁堂	800	23,200.00	0.15
158	300347	泰格医药	300	23,130.00	0.15
159	002410	广联达	700	23,023.00	0.15
160	601111	中国国航	2,400	22,968.00	0.15
161	300124	汇川技术	1,000	22,910.00	0.15
162	002032	苏 泊 尔	300	22,749.00	0.14
163	603369	今世缘	800	22,312.00	0.14
164	600297	广汇汽车	5,000	22,300.00	0.14
165	002673	西部证券	2,200	22,176.00	0.14
166	600637	东方明珠	2,100	22,134.00	0.14
167	601607	上海医药	1,200	21,780.00	0.14
168	002179	中航光电	650	21,749.00	0.14
169	002493	荣盛石化	1,800	21,708.00	0.14
170	600489	中金黄金	2,100	21,567.00	0.14
171	603833	欧派家居	200	21,524.00	0.14
172	600872	中炬高新	500	21,415.00	0.14
173	300628	亿联网络	200	21,414.00	0.14
174	000425	徐工机械	4,800	21,408.00	0.14
175	300408	三环集团	1,100	21,395.00	0.14
176	300601	康泰生物	400	21,000.00	0.13
177	601998	中信银行	3,500	20,895.00	0.13
178	300144	宋城演艺	900	20,826.00	0.13
179	002371	北方华创	300	20,775.00	0.13
180	002506	协鑫集成	3,100	20,708.00	0.13

181	600176	中国巨石	2,162	20,603.86	0.13
182	600895	张江高科	1,000	20,520.00	0.13
183	600362	江西铜业	1,300	20,462.00	0.13
184	002271	东方雨虹	900	20,394.00	0.13
185	600170	上海建工	5,400	20,304.00	0.13
186	601198	东兴证券	1,700	20,196.00	0.13
187	600487	亨通光电	1,200	20,112.00	0.13
188	600867	通化东宝	1,300	20,020.00	0.13
189	600600	青岛啤酒	400	19,972.00	0.13
190	000961	中南建设	2,300	19,918.00	0.13
191	603019	中科曙光	560	19,656.00	0.13
192	000860	顺鑫农业	420	19,593.00	0.12
193	601919	中远海控	3,900	19,578.00	0.12
194	600183	生益科技	1,300	19,565.00	0.12
195	600177	雅戈尔	3,080	19,558.00	0.12
196	600498	烽火通信	700	19,502.00	0.12
197	000709	河钢股份	6,500	19,435.00	0.12
198	601838	成都银行	2,200	19,426.00	0.12
199	600688	上海石化	3,762	19,411.92	0.12
200	002405	四维图新	1,200	19,320.00	0.12
201	000656	金科股份	3,200	19,296.00	0.12
202	601800	中国交建	1,700	19,244.00	0.12
203	601992	金隅集团	5,100	19,176.00	0.12
204	000977	浪潮信息	800	19,088.00	0.12
205	000999	华润三九	647	18,982.98	0.12
206	300529	健帆生物	300	18,705.00	0.12
207	000066	中国长城	1,800	18,504.00	0.12
208	601555	东吴证券	1,800	18,450.00	0.12
209	600011	华能国际	2,961	18,447.03	0.12
210	000728	国元证券	2,000	18,340.00	0.12
211	600066	宇通客车	1,400	18,228.00	0.12
212	002050	三花智控	1,720	18,146.00	0.12
213	000786	北新建材	1,000	18,130.00	0.12
214	002153	石基信息	500	18,095.00	0.12
215	601117	中国化学	3,000	18,060.00	0.11
216	600875	东方电气	1,700	18,054.00	0.11
217	002555	三七互娱	1,330	18,021.50	0.11
218	002601	龙蟠佰利	1,200	17,796.00	0.11
219	002241	歌尔股份	2,000	17,780.00	0.11
220	600989	宝丰能源	1,500	17,715.00	0.11
221	002466	天齐锂业	700	17,696.00	0.11
222	600845	宝信软件	620	17,657.60	0.11
223	002049	紫光国微	400	17,644.00	0.11
224	600109	国金证券	1,800	17,496.00	0.11

225	000050	深天马 A	1,300	17,472.00	0.11
226	600068	葛洲坝	2,800	17,444.00	0.11
227	600522	中天科技	1,900	17,423.00	0.11
228	600760	中航沈飞	600	17,418.00	0.11
229	603986	兆易创新	200	17,340.00	0.11
230	601360	三六零	800	17,104.00	0.11
231	601233	桐昆股份	1,100	17,061.00	0.11
232	600801	华新水泥	840	17,010.00	0.11
233	000413	东旭光电	3,300	16,962.00	0.11
234	601997	贵阳银行	1,960	16,954.00	0.11
235	002127	南极电商	1,500	16,860.00	0.11
236	600642	申能股份	2,800	16,828.00	0.11
237	002926	华西证券	1,600	16,800.00	0.11
238	300450	先导智能	500	16,800.00	0.11
239	600369	西南证券	3,400	16,796.00	0.11
240	000938	紫光股份	616	16,786.00	0.11
241	601216	君正集团	5,100	16,779.00	0.11
242	002372	伟星新材	960	16,704.00	0.11
243	600089	特变电工	2,300	16,675.00	0.11
244	600816	安信信托	3,300	16,665.00	0.11
245	002600	领益智造	2,800	16,604.00	0.11
246	002129	中环股份	1,700	16,592.00	0.11
247	600219	南山铝业	7,300	16,498.00	0.11
248	002081	金螳螂	1,600	16,496.00	0.11
249	300413	芒果超媒	400	16,420.00	0.10
250	600038	中直股份	400	16,408.00	0.10
251	002460	赣锋锂业	700	16,401.00	0.10
252	600655	豫园股份	2,000	16,380.00	0.10
253	600208	新潮中宝	5,200	16,328.00	0.10
254	600398	海澜之家	1,800	16,326.00	0.10
255	600188	兖州煤业	1,500	16,305.00	0.10
256	600100	同方股份	1,800	16,290.00	0.10
257	002508	老板电器	600	16,284.00	0.10
258	000627	天茂集团	2,500	16,225.00	0.10
259	000671	阳光城	2,500	16,200.00	0.10
260	600528	中铁工业	1,400	16,198.00	0.10
261	300017	网宿科技	1,500	16,170.00	0.10
262	002439	启明星辰	600	16,140.00	0.10
263	601872	招商轮船	3,700	16,132.00	0.10
264	600536	中国软件	300	16,101.00	0.10
265	000423	东阿阿胶	400	15,928.00	0.10
266	000625	长安汽车	2,400	15,912.00	0.10
267	000975	银泰资源	1,200	15,828.00	0.10
268	002180	纳思达	700	15,820.00	0.10

269	600298	安琪酵母	500	15,815.00	0.10
270	601878	浙商证券	1,700	15,810.00	0.10
271	600118	中国卫星	700	15,785.00	0.10
272	600497	驰宏锌锗	3,100	15,748.00	0.10
273	000630	铜陵有色	6,400	15,744.00	0.10
274	601100	恒立液压	500	15,690.00	0.10
275	600977	中国电影	1,000	15,660.00	0.10
276	002558	巨人网络	859	15,608.03	0.10
277	601238	广汽集团	1,420	15,520.60	0.10
278	600027	华电国际	4,100	15,457.00	0.10
279	002373	千方科技	900	15,390.00	0.10
280	000898	鞍钢股份	4,050	15,349.50	0.10
281	002507	涪陵榨菜	500	15,250.00	0.10
282	600779	水井坊	300	15,246.00	0.10
283	300014	亿纬锂能	500	15,230.00	0.10
284	002299	圣农发展	600	15,192.00	0.10
285	600161	天坛生物	600	15,150.00	0.10
286	002013	中航机电	2,200	15,136.00	0.10
287	600583	海油工程	2,700	15,120.00	0.10
288	600153	建发股份	1,700	15,096.00	0.10
289	300383	光环新网	900	15,093.00	0.10
290	002010	传化智联	2,000	15,060.00	0.10
291	600535	天士力	900	14,895.00	0.09
292	600426	华鲁恒升	1,000	14,860.00	0.09
293	600998	九州通	1,200	14,832.00	0.09
294	300070	碧水源	1,900	14,801.00	0.09
295	600566	济川药业	491	14,784.01	0.09
296	600155	华创阳安	1,100	14,773.00	0.09
297	002223	鱼跃医疗	600	14,772.00	0.09
298	601699	潞安环能	1,855	14,728.70	0.09
299	300136	信维通信	600	14,670.00	0.09
300	601099	太平洋	4,100	14,596.00	0.09
301	600256	广汇能源	4,100	14,596.00	0.09
302	002384	东山精密	1,000	14,570.00	0.09
303	002110	三钢闽光	1,550	14,415.00	0.09
304	603885	吉祥航空	1,100	14,410.00	0.09
305	600909	华安证券	2,200	14,388.00	0.09
306	600376	首开股份	1,600	14,288.00	0.09
307	603799	华友钴业	668	14,235.08	0.09
308	300253	卫宁健康	1,000	14,180.00	0.09
309	600673	东阳光	1,800	14,130.00	0.09
310	000402	金融街	1,800	14,112.00	0.09
311	600704	物产中大	2,600	14,092.00	0.09
312	000401	冀东水泥	800	14,088.00	0.09



313	300433	蓝思科技	2,000	13,940.00	0.09
314	601098	中南传媒	1,100	13,904.00	0.09
315	600021	上海电力	1,600	13,888.00	0.09
316	002353	杰瑞股份	600	13,860.00	0.09
317	600776	东方通信	600	13,788.00	0.09
318	002500	山西证券	1,700	13,770.00	0.09
319	002385	大北农	2,600	13,754.00	0.09
320	300024	机器人	900	13,707.00	0.09
321	002195	二三四五	3,510	13,653.90	0.09
322	600415	小商品城	3,300	13,596.00	0.09
323	600372	中航电子	900	13,356.00	0.09
324	002465	海格通信	1,400	13,356.00	0.09
325	600959	江苏有线	3,000	13,350.00	0.09
326	002456	欧菲光	1,700	13,328.00	0.08
327	002797	第一创业	2,100	13,314.00	0.08
328	002065	东华软件	1,900	13,281.00	0.08
329	600460	士兰微	800	13,280.00	0.08
330	000732	泰禾集团	800	13,200.00	0.08
331	601106	中国一重	4,200	13,188.00	0.08
332	000686	东北证券	1,491	13,135.71	0.08
333	600739	辽宁成大	900	13,086.00	0.08
334	600675	中华企业	2,520	13,078.80	0.08
335	000750	国海证券	2,600	13,078.00	0.08
336	601866	中远海发	4,800	13,056.00	0.08
337	601598	中国外运	2,700	12,933.00	0.08
338	002624	完美世界	500	12,905.00	0.08
339	603858	步长制药	500	12,885.00	0.08
340	600549	厦门钨业	900	12,879.00	0.08
341	600584	长电科技	1,000	12,850.00	0.08
342	000031	大悦城	2,000	12,840.00	0.08
343	002773	康弘药业	390	12,838.80	0.08
344	600699	均胜电子	600	12,816.00	0.08
345	002399	海普瑞	600	12,594.00	0.08
346	603000	人民网	700	12,481.00	0.08
347	600315	上海家化	400	12,460.00	0.08
348	000027	深圳能源	2,000	12,400.00	0.08
349	600008	首创股份	3,500	12,320.00	0.08
350	600808	马钢股份	3,600	12,276.00	0.08
351	300251	光线传媒	1,800	12,240.00	0.08
352	002268	卫士通	500	12,225.00	0.08
353	002563	森马服饰	1,100	12,166.00	0.08
354	600392	盛和资源	1,100	12,166.00	0.08
355	600885	宏发股份	500	12,150.00	0.08
356	600160	巨化股份	1,700	12,087.00	0.08

357	000932	华菱钢铁	2,520	12,020.40	0.08
358	600820	隧道股份	1,900	11,989.00	0.08
359	601966	玲珑轮胎	700	11,900.00	0.08
360	600339	中油工程	2,800	11,816.00	0.08
361	600598	北大荒	1,100	11,803.00	0.08
362	002340	格林美	2,500	11,775.00	0.07
363	300296	利亚德	1,500	11,745.00	0.07
364	000046	泛海控股	2,100	11,718.00	0.07
365	603883	老百姓	200	11,696.00	0.07
366	000998	隆平高科	800	11,584.00	0.07
367	000983	西山煤电	1,900	11,514.00	0.07
368	600511	国药股份	500	11,485.00	0.07
369	000623	吉林敖东	700	11,473.00	0.07
370	601179	中国西电	3,100	11,470.00	0.07
371	300676	华大基因	200	11,408.00	0.07
372	600258	首旅酒店	630	11,327.40	0.07
373	000039	中集集团	1,060	11,320.80	0.07
374	000729	燕京啤酒	1,700	11,288.00	0.07
375	000883	湖北能源	2,600	11,284.00	0.07
376	600521	华海药业	800	11,280.00	0.07
377	600967	内蒙一机	1,000	11,200.00	0.07
378	600466	蓝光发展	1,800	11,196.00	0.07
379	002294	信立泰	500	11,190.00	0.07
380	000960	锡业股份	1,000	11,170.00	0.07
381	002572	索菲亚	600	11,136.00	0.07
382	300072	三聚环保	1,400	11,102.00	0.07
383	600380	健康元	1,280	11,072.00	0.07
384	600026	中远海能	1,700	11,033.00	0.07
385	600863	内蒙华电	3,500	10,990.00	0.07
386	600201	生物股份	700	10,983.00	0.07
387	601333	广深铁路	3,400	10,982.00	0.07
388	600486	扬农化工	200	10,940.00	0.07
389	002078	太阳纸业	1,600	10,896.00	0.07
390	601958	金铂股份	1,600	10,720.00	0.07
391	000778	新兴铸管	2,400	10,656.00	0.07
392	000826	启迪桑德	900	10,611.00	0.07
393	600572	康恩贝	1,650	10,560.00	0.07
394	601718	际华集团	2,700	10,557.00	0.07
395	002217	合力泰	1,900	10,507.00	0.07
396	600648	外高桥	500	10,490.00	0.07
397	600879	航天电子	1,700	10,472.00	0.07
398	600737	中粮糖业	1,200	10,416.00	0.07
399	600273	嘉化能源	900	10,404.00	0.07
400	002092	中泰化学	1,300	10,348.00	0.07

401	000060	中金岭南	2,200	10,318.00	0.07
402	000503	国新健康	600	10,296.00	0.07
403	002152	广电运通	1,500	10,275.00	0.07
404	603077	和邦生物	5,400	10,260.00	0.07
405	600718	东软集团	800	10,256.00	0.07
406	000559	万向钱潮	1,700	10,166.00	0.06
407	600500	中化国际	1,359	10,151.73	0.06
408	000997	新大陆	600	10,134.00	0.06
409	600373	中文传媒	800	10,048.00	0.06
410	601880	大连港	4,700	10,011.00	0.06
411	000513	丽珠集团	300	9,969.00	0.06
412	601000	唐山港	3,600	9,900.00	0.06
413	600446	金证股份	500	9,820.00	0.06
414	600827	百联股份	1,000	9,810.00	0.06
415	000830	鲁西化工	900	9,792.00	0.06
416	600649	城投控股	1,500	9,705.00	0.06
417	000839	中信国安	2,400	9,648.00	0.06
418	600643	爱建集团	1,000	9,580.00	0.06
419	600782	新钢股份	1,900	9,500.00	0.06
420	002085	万丰奥威	1,300	9,464.00	0.06
421	600282	南钢股份	2,700	9,450.00	0.06
422	600056	中国医药	700	9,443.00	0.06
423	600567	山鹰纸业	2,800	9,436.00	0.06
424	002038	双鹭药业	400	9,424.00	0.06
425	000738	航发控制	700	9,380.00	0.06
426	002812	恩捷股份	200	9,350.00	0.06
427	000581	威孚高科	500	9,280.00	0.06
428	002583	海能达	1,100	9,229.00	0.06
429	002074	国轩高科	700	9,177.00	0.06
430	002174	游族网络	542	9,148.96	0.06
431	002124	天邦股份	700	9,128.00	0.06
432	600873	梅花生物	1,900	9,101.00	0.06
433	002019	亿帆医药	735	9,003.75	0.06
434	601168	西部矿业	1,400	8,932.00	0.06
435	002424	贵州百灵	900	8,892.00	0.06
436	600037	歌华有线	861	8,825.25	0.06
437	600348	阳泉煤业	1,500	8,715.00	0.06
438	600582	天地科技	2,500	8,625.00	0.05
439	002221	东华能源	1,000	8,610.00	0.05
440	600777	新潮能源	4,100	8,528.00	0.05
441	600079	人福医药	800	8,400.00	0.05
442	000028	国药一致	200	8,366.00	0.05
443	600835	上海机电	500	8,300.00	0.05
444	600277	亿利洁能	1,700	8,279.00	0.05

445	000990	诚志股份	500	8,205.00	0.05
446	002745	木林森	700	8,204.00	0.05
447	000598	兴蓉环境	1,800	8,190.00	0.05
448	002603	以岭药业	700	8,106.00	0.05
449	000937	冀中能源	2,100	8,106.00	0.05
450	002640	跨境通	967	8,055.11	0.05
451	600260	凯乐科技	400	7,992.00	0.05
452	000681	视觉中国	400	7,752.00	0.05
453	600717	天津港	1,200	7,704.00	0.05
454	600062	华润双鹤	600	7,566.00	0.05
455	600884	杉杉股份	700	7,455.00	0.05
456	600787	中储股份	1,300	7,449.00	0.05
457	600754	锦江股份	300	7,392.00	0.05
458	600409	三友化工	1,300	7,358.00	0.05
459	002470	金正大	2,000	7,280.00	0.05
460	600291	西水股份	700	7,042.00	0.04
461	000887	中鼎股份	700	6,713.00	0.04

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	600519	贵州茅台	495,487.00	0.46
2	000661	长春高新	382,796.00	0.36
3	002916	深南电路	219,224.00	0.20
4	000538	云南白药	198,819.00	0.18
5	603833	欧派家居	191,110.00	0.18
6	600276	恒瑞医药	173,175.00	0.16
7	000596	古井贡酒	149,374.00	0.14
8	601318	中国平安	138,828.00	0.13
9	600036	招商银行	137,480.00	0.13
10	000651	格力电器	132,439.00	0.12
11	000002	万科A	119,435.00	0.11
12	300498	温氏股份	119,366.00	0.11
13	000858	五粮液	116,688.00	0.11
14	000333	美的集团	116,650.00	0.11
15	002415	海康威视	116,454.00	0.11
16	603883	老百姓	103,721.00	0.10
17	002714	牧原股份	101,459.00	0.09
18	002594	比亚迪	97,013.00	0.09

19	000028	国药一致	92,253.00	0.09
20	600486	扬农化工	88,170.00	0.08

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	000333	美的集团	1,672,379.00	1.55
2	002415	海康威视	1,561,648.68	1.45
3	000002	万科 A	1,423,314.80	1.32
4	000858	五粮液	1,300,961.00	1.21
5	000001	平安银行	1,028,726.00	0.96
6	002304	洋河股份	828,945.00	0.77
7	000651	格力电器	740,220.69	0.69
8	001979	招商蛇口	678,623.00	0.63
9	000661	长春高新	631,837.00	0.59
10	000538	云南白药	571,649.74	0.53
11	002024	苏宁易购	550,292.00	0.51
12	000725	京东方 A	538,057.00	0.50
13	002594	比亚迪	530,461.00	0.49
14	002142	宁波银行	497,690.56	0.46
15	000166	申万宏源	459,963.00	0.43
16	000776	广发证券	439,297.00	0.41
17	002714	牧原股份	408,175.00	0.38
18	000063	中兴通讯	404,700.00	0.38
19	002027	分众传媒	377,960.00	0.35
20	000568	泸州老窖	370,389.00	0.34

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	10,816,323.97
卖出股票的收入（成交）总额	38,923,708.31

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金合同无国债期货投资政策。

### 7.11.2 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。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 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

本基金本报告期末未持有基金投资。

### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

#### 7.13.3 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	110,921.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	111.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,033.74

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

#### 7.13.6 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。

## 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
198	66,124.44	1,986,140.00	15.17%	11,106,500.00	84.83%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年11月7日）基金份额总额	280,092,640.00
本报告期期初基金份额总额	115,092,640.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	105,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,092,640.00



## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 4 月 18 日，陈重先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司董事长。

2019 年 4 月 18 日，张宗友先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司总经理。

2019 年 4 月 18 日，张宗友先生新任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司董事长，代任总经理。

2019 年 6 月 6 日，刘全胜先生新任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司总经理。

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

华创证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	32,850,340.68	66.74%	6,011.35	30.81%	-
中泰证券	1	3,596,400.00	7.31%	3,348.97	17.16%	-
天风证券	1	3,307,521.00	6.72%	2,418.68	12.40%	-
中金公司	1	2,353,437.90	4.78%	2,191.99	11.23%	-
国盛证券	2	1,648,428.90	3.35%	1,205.66	6.18%	-
银河证券	1	1,219,395.00	2.48%	891.72	4.57%	-
东吴证券	1	1,002,592.78	2.04%	733.18	3.76%	-
东兴证券	2	592,923.24	1.20%	433.51	2.22%	-
国金证券	1	421,755.44	0.86%	392.80	2.01%	-
中信建投	1	390,836.75	0.79%	285.79	1.46%	-
国泰君安	1	352,384.25	0.72%	328.19	1.68%	-
恒泰证券	2	339,283.66	0.69%	273.15	1.40%	-
兴业证券	1	229,235.00	0.47%	213.53	1.09%	-
申万宏源	1	204,470.26	0.42%	190.46	0.98%	-
招商证券	1	166,467.00	0.34%	155.01	0.79%	-
浙商证券	1	161,575.82	0.33%	118.17	0.61%	-
安信证券	1	156,006.52	0.32%	114.04	0.58%	-
新时代证券	2	125,562.00	0.26%	116.94	0.60%	-
光大证券	1	44,697.00	0.09%	41.63	0.21%	-
中信证券	2	36,940.00	0.08%	34.40	0.18%	-
中银国际证券	2	18,691.00	0.04%	13.66	0.07%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用 43 个交易席位，其中报告期内新增 0 个交易席位；退租 1 个交易席位，退租席位为：国海证券深圳席位。

#### 一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

#### 二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。

2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

#### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的信威集团估值方法调整的公告	证券日报、公司网站	2019-02-14
2	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2019-04-18
3	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券时报、公司网站	2019-04-20
4	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券时报、公司网站	2019-06-11
5	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	公司网站	2019-06-20
6	新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要	证券时报、公司网站	2019-06-20
7	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2019-06-24
8	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2019 年半年度最后一日交易日资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2019-06-29

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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
个人	1	20190313-20190630	2,985,000.00	-	185,800.00	2,799,200.00	21.38%
产品特有风险							
<p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (四) 新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数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) 《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 12.3 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

二〇一九年八月二十四日