

# 新华中小市值优选混合型证券投资基金

## 2019 年半年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十四日

## 1 重要提示

### 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。

基金托管人中国建设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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	新华中小市值优选混合
基金主代码	519097
交易代码	519097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 28 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,480,394.59 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资，力求实现基金净值增长率持续地超越业绩比较基准。
投资策略	资产配置策略：本基金采用战略性资产配置与战术性资产配置相结合的策略，即在各类资产的投资比例范围内，持续评估各类资产的风险收益状况，并据此动态调整资产配置比例，以从变化的市场环境下最大程度地获利。 股票投资策略：本基金以合理价格成长选股策略（GARP）为核心，精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资。债券投资策略：本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。
业绩比较基准	80%×中证 700 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金资产整体的预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	田青
	联系电话	010-68779688	010-67595096
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008198866	010-67595096
传真		010-68779528	010-66275865

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要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、基金托管人的办公地。

### 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	13,441,901.59
本期利润	15,214,054.70
加权平均基金份额本期利润	0.3140
本期基金份额净值增长率	29.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.3658
期末基金资产净值	71,877,299.35
期末基金份额净值	1.483

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
过去一个月	1.78%	1.40%	1.51%	1.03%	0.27%	0.37%
过去三个月	-8.06%	1.97%	-7.20%	1.39%	-0.86%	0.58%
过去六个月	29.75%	1.95%	17.24%	1.39%	12.51%	0.56%
过去一年	11.00%	1.82%	-1.08%	1.33%	12.08%	0.49%
过去三年	-4.69%	1.41%	-8.49%	1.00%	3.80%	0.41%
自基金合同生效起至今	111.86%	1.49%	12.83%	1.32%	99.03%	0.17%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中证 700 指数收益率，债券投资部分的业绩比较基准选择上证国债指数收益率，复合业绩比较基准为 80%×中证 700 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

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

新华中小市值优选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历史走势对比图  
 (2011 年 1 月 28 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：1、本基金于 2011 年 1 月 28 日基金合同生效。

2、本报告期末本基金各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

## 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		
付伟	本基金基金经理，新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。	2016-06-17	-	9	西安交通大学工学硕士，北京大学工商管理硕士，历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理，新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与 TMT 组组长，先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。

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中小市值优选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》、《新华中小市值优选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

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现重大异常情况，且不存在报告期内所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

2019 年上半年 A 股市场呈现冲高回落走势，大部分板块取得正收益，尤其以消费板块表现最突出，科技板块亦有较好收益。本基金根据基金合同约定，精选各个行业中具有较高成长性且估值合

理的中小市值股票进行投资，追求获取长期超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.483 元，本报告期份额净值增长率为 29.75%，同期比较基准的增长率为 17.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从政府部门的表态和会议精神可以看出，经济下行的压力仍然存在，但政策整体上保持了很强大定力。政府当前对于经济增长有更高的包容度和更长远的视角，传统的刺激手段有一定淡化，消费的托底作用凸显，改革的决心更加坚定。

市场整体估值水平仍处于较低水平，本基金将保持中性偏高仓位，注意把握其中的结构性机会，更多关注景气度处于底部复苏或持续提升的产业机会。行业配置重点关注科技方向的电子、通信、计算机，盈利稳定的医药、公用事业，以及处于大周期拐点的农林牧渔、汽车等。个股选择上，重点布局调整充分，业绩稳健，估值处于较低水平，成长性良好的个股。

#### 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

本报告期内，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况。

### 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 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

本托管人复核审查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。

### 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：新华中小市值优选混合型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	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	4,342,920.13	21,014,889.11

结算备付金	943,778.12	867,906.80
存出保证金	156,386.18	97,873.23
交易性金融资产	67,918,720.39	44,091,684.76
其中：股票投资	67,918,720.39	44,091,684.76
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	745,124.43	-
应收利息	1,210.74	4,188.85
应收股利	-	-
应收申购款	14,699.96	9,769.67
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>74,122,839.95</b>	<b>66,086,312.42</b>
<b>负债和所有者权益</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	526,473.35	12,989,511.56
应付赎回款	145,168.53	52,018.90
应付管理人报酬	86,997.46	69,463.61
应付托管费	14,499.56	11,577.27
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,385,815.89	540,983.58
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	86,585.81	380,138.97
<b>负债合计</b>	<b>2,245,540.60</b>	<b>14,043,693.89</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	48,480,394.59	45,521,401.60
未分配利润	23,396,904.76	6,521,216.93
<b>所有者权益合计</b>	<b>71,877,299.35</b>	<b>52,042,618.53</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>74,122,839.95</b>	<b>66,086,312.42</b>

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.483 元，基金份额总额 48,480,394.59 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华中小市值优选混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>18,111,318.40</b>	<b>-6,583,845.11</b>
1.利息收入	42,876.46	53,595.16
其中：存款利息收入	42,876.46	44,869.12
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	-	8,726.04
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	16,239,161.31	-5,480,253.88
其中：股票投资收益	15,967,704.11	-5,672,862.87
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	271,457.20	192,608.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,772,153.11	-1,175,134.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	57,127.52	17,948.38
<b>减：二、费用</b>	<b>2,897,263.70</b>	<b>2,901,446.69</b>
1. 管理人报酬	518,712.42	530,252.22
2. 托管费	86,452.12	88,375.35
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,201,316.70	2,090,398.94
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	90,782.46	192,420.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>15,214,054.70</b>	<b>-9,485,291.80</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>15,214,054.70</b>	<b>-9,485,291.80</b>

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华中小市值优选混合型证券投资基金

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）	45,521,401.60	6,521,216.93	52,042,618.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,214,054.70	15,214,054.70
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）	2,958,992.99	1,661,633.13	4,620,626.12
其中：1.基金申购款	23,303,431.02	13,463,580.88	36,767,011.90
2.基金赎回款	-20,344,438.03	-11,801,947.75	-32,146,385.78
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）	48,480,394.59	23,396,904.76	71,877,299.35
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	74,707,001.27	41,976,191.02	116,683,192.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,485,291.80	-9,485,291.80
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）	-30,008,753.45	-17,465,493.20	-47,474,246.65
其中：1.基金申购款	4,070,013.03	1,995,633.65	6,065,646.68
2.基金赎回款	-34,078,766.48	-19,461,126.85	-53,539,893.33
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）	44,698,247.82	15,025,406.02	59,723,653.84

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

新华中小市值优选混合型证券投资基金(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[2010]1403 号文件“关于核准新华中小市值优选混合型证券投资基金募集的批复”,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2011 年 1 月 4 日至 1 月 25 日向社会公开募集,首次募集资金总额 742,965,884.43 元,其中募集净认购资金金额 742,773,420.20 元,募集资金产生利息 192,464.23 元,并经国富浩华会计师事务所(特殊普通合伙)浩华验字[2011]第 1 号验资报告予以验证。2011 年 1 月 28 日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书》及《新华中小市值优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%,其中中小市值股票投资占基金股票资产的比例不低于 80%,债券投资占基金资产的比例范围为 0%-40%,资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0%-20%,权证投资占基金资产净值的比例范围为 0%-3%,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:80%\*中证 700 指数收益率+20%\*上证国债指数收益率。

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 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华中小市值优选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。

### 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的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

### 6.4.4 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与上年度一致、会计估计与上年度一致。

#### 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

本基金报告期内未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

#### 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、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》的规定：2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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。

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 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[2016]140 号）、《关于资管产品增值税政策有关

问题的补充通知》(财税[2017]2 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税[2017]90 号)的规定,自 2018 年 1 月 1 日起,证券投资基金在运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法,按照现行规定缴纳增值税及附加税费。

### 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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 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		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总



		额的比例		额的比例
恒泰证券股份有限 公司	426,202,580.19	26.19%	418,114,983.38	27.15%

#### 6.4.8.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
恒泰证券股份有限 公司	311,681.15	25.02%	311,681.15	22.49%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
恒泰证券股份有限 公司	305,767.33	25.98%	74,537.94	10.32%

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。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	518,712.42	530,252.22

其中：支付销售机构的客户维护费	250,190.39	255,868.16
-----------------	------------	------------

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,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	86,452.12	88,375.35

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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。

##### 6.4.8.4.2 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。

#### 6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	4,342,920.13	30,866.34	10,205,016.79	32,904.90

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

**6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	网下中签	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

截止报告期期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金报告期末无银行间市场债券正回购余额。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金报告期末无交易所市场债券正回购余额。

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**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	67,918,720.39	91.63
	其中：股票	67,918,720.39	91.63
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,286,698.25	7.13
7	其他各项资产	917,421.31	1.24
8	合计	74,122,839.95	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,978,442.65	5.54
C	制造业	46,785,946.04	65.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,080,000.00	5.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,062,261.76	12.61
J	金融业	33,869.94	0.05
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	-	-
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	3,978,200.00	5.53
S	综合	-	-

	合计	67,918,720.39	94.49
--	----	---------------	-------

### 7.3 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	600872	中炬高新	70,000	2,998,100.00	4.17
2	600760	中航沈飞	100,000	2,903,000.00	4.04
3	600004	白云机场	150,000	2,730,000.00	3.80
4	600588	用友网络	100,000	2,688,000.00	3.74
5	600584	长电科技	200,000	2,570,000.00	3.58
6	600298	安琪酵母	80,057	2,532,202.91	3.52
7	601633	长城汽车	300,000	2,481,000.00	3.45
8	601949	中国出版	370,000	2,405,000.00	3.35
9	600867	通化东宝	150,000	2,310,000.00	3.21
10	002371	北方华创	33,000	2,285,250.00	3.18

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

### 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	002714	牧原股份	11,708,768.56	22.50
2	002234	民和股份	10,184,783.00	19.57
3	000858	五粮液	8,478,398.00	16.29
4	601881	中国银河	7,973,003.62	15.32
5	000750	国海证券	7,959,406.00	15.29
6	002124	天邦股份	7,625,322.46	14.65
7	000063	中兴通讯	7,261,486.00	13.95
8	000100	TCL 集团	7,163,470.00	13.76
9	002343	慈文传媒	6,608,944.00	12.70
10	300498	温氏股份	6,513,044.00	12.51
11	000876	新希望	6,504,192.80	12.50
12	000625	长安汽车	6,431,843.20	12.36
13	603019	中科曙光	6,324,159.60	12.15
14	600831	广电网络	6,259,833.22	12.03

15	002174	游族网络	6,038,683.00	11.60
16	000725	京东方 A	6,006,000.00	11.54
17	600588	用友网络	5,934,968.60	11.40
18	601336	新华保险	5,915,625.56	11.37
19	002241	歌尔股份	5,708,008.00	10.97
20	600872	中炬高新	5,499,352.00	10.57
21	603288	海天味业	5,386,829.04	10.35
22	600996	贵广网络	5,359,251.06	10.30
23	600136	当代明诚	5,285,576.98	10.16
24	300657	弘信电子	5,193,578.00	9.98
25	002405	四维图新	5,189,779.94	9.97
26	000732	泰禾集团	5,159,968.00	9.91
27	300115	长盈精密	5,052,757.00	9.71
28	002268	卫士通	5,025,057.00	9.66
29	000977	浪潮信息	4,991,400.00	9.59
30	000156	华数传媒	4,984,648.83	9.58
31	002670	国盛金控	4,967,195.95	9.54
32	300356	光一科技	4,871,416.00	9.36
33	603825	华扬联众	4,860,560.80	9.34
34	000729	燕京啤酒	4,833,955.00	9.29
35	601633	长城汽车	4,708,252.08	9.05
36	603323	苏农银行	4,695,978.00	9.02
37	600570	恒生电子	4,688,786.00	9.01
38	002321	华英农业	4,683,572.00	9.00
39	601858	中国科传	4,572,115.50	8.79
40	600088	中视传媒	4,561,447.20	8.76
41	000839	中信国安	4,539,431.00	8.72
42	300569	天能重工	4,365,598.60	8.39
43	600779	水井坊	4,349,587.71	8.36
44	600977	中国电影	4,222,481.00	8.11
45	002929	润建股份	4,183,277.00	8.04
46	600196	复星医药	4,136,469.86	7.95
47	000921	海信家电	4,104,672.00	7.89
48	600958	东方证券	4,096,099.03	7.87
49	600760	中航沈飞	3,981,543.00	7.65
50	300659	中孚信息	3,966,313.59	7.62
51	603609	禾丰牧业	3,955,362.78	7.60
52	300688	创业黑马	3,913,796.00	7.52
53	300426	唐德影视	3,876,879.27	7.45
54	002238	天威视讯	3,872,140.24	7.44
55	300655	晶瑞股份	3,809,453.00	7.32
56	002594	比亚迪	3,809,062.00	7.32
57	002146	荣盛发展	3,792,605.00	7.29
58	600536	中国软件	3,771,664.00	7.25

59	000728	国元证券	3,745,541.41	7.20
60	603517	绝味食品	3,723,729.85	7.16
61	600936	广西广电	3,656,415.00	7.03
62	600519	贵州茅台	3,638,340.00	6.99
63	002100	天康生物	3,625,665.16	6.97
64	601238	广汽集团	3,605,517.80	6.93
65	600745	闻泰科技	3,576,164.00	6.87
66	002371	北方华创	3,519,671.00	6.76
67	600690	海尔智家	3,450,984.00	6.63
68	000401	冀东水泥	3,402,812.90	6.54
69	600600	青岛啤酒	3,370,544.00	6.48
70	002867	周大生	3,323,416.68	6.39
71	603369	今世缘	3,291,482.00	6.32
72	600584	长电科技	3,281,731.00	6.31
73	300027	华谊兄弟	3,266,563.28	6.28
74	600004	白云机场	3,255,893.15	6.26
75	600559	老白干酒	3,161,592.00	6.08
76	600340	华夏幸福	3,148,995.00	6.05
77	600887	伊利股份	3,146,678.36	6.05
78	603078	江化微	3,133,872.00	6.02
79	002299	圣农发展	3,114,966.28	5.99
80	601949	中国出版	3,104,331.00	5.96
81	600975	新五丰	3,018,732.41	5.80
82	600298	安琪酵母	2,979,852.75	5.73
83	300058	蓝色光标	2,978,937.48	5.72
84	000917	电广传媒	2,972,441.00	5.71
85	300113	顺网科技	2,970,161.00	5.71
86	603589	口子窖	2,958,462.00	5.68
87	600422	昆药集团	2,951,479.00	5.67
88	000572	*ST 海马	2,931,000.00	5.63
89	002157	正邦科技	2,908,063.00	5.59
90	600703	三安光电	2,907,143.00	5.59
91	603516	淳中科技	2,900,335.56	5.57
92	000568	泸州老窖	2,873,254.00	5.52
93	603515	欧普照明	2,872,010.44	5.52
94	600801	华新水泥	2,847,810.00	5.47
95	600699	均胜电子	2,807,996.00	5.40
96	300413	芒果超媒	2,796,165.00	5.37
97	002235	安妮股份	2,763,782.50	5.31
98	300686	智动力	2,753,862.80	5.29
99	600267	海正药业	2,744,683.00	5.27
100	300661	圣邦股份	2,725,926.27	5.24
101	000665	湖北广电	2,718,990.41	5.22
102	000799	酒鬼酒	2,657,987.00	5.11

103	601966	玲珑轮胎	2,635,245.00	5.06
104	600985	淮北矿业	2,623,686.00	5.04
105	000560	我爱我家	2,613,242.25	5.02
106	002461	珠江啤酒	2,603,408.00	5.00
107	601021	春秋航空	2,567,650.00	4.93
108	600373	中文传媒	2,537,104.45	4.88
109	600523	贵航股份	2,525,402.00	4.85
110	600305	恒顺醋业	2,513,454.30	4.83
111	000895	双汇发展	2,502,062.00	4.81
112	002458	益生股份	2,447,643.30	4.70
113	002035	华帝股份	2,440,192.30	4.69
114	600637	东方明珠	2,424,977.10	4.66
115	000676	智度股份	2,413,329.00	4.64
116	300043	星辉娱乐	2,352,791.00	4.52
117	600742	一汽富维	2,347,110.00	4.51
118	603000	人民网	2,345,638.00	4.51
119	601699	潞安环能	2,344,000.00	4.50
120	002142	宁波银行	2,337,489.32	4.49
121	000671	阳光城	2,308,087.08	4.43
122	600867	通化东宝	2,294,368.46	4.41
123	002746	仙坛股份	2,268,840.60	4.36
124	600383	金地集团	2,259,618.00	4.34
125	603833	欧派家居	2,238,711.00	4.30
126	000960	锡业股份	2,231,392.78	4.29
127	601066	中信建投	2,230,970.30	4.29
128	300182	捷成股份	2,195,685.00	4.22
129	000915	山大华特	2,189,841.00	4.21
130	603444	吉比特	2,186,641.54	4.20
131	300146	汤臣倍健	2,180,283.00	4.19
132	000559	万向钱潮	2,178,491.80	4.19
133	002163	中航三鑫	2,166,457.17	4.16
134	300474	景嘉微	2,161,058.00	4.15
135	300556	丝路视觉	2,160,477.00	4.15
136	002468	申通快递	2,145,419.00	4.12
137	601555	东吴证券	2,115,856.42	4.07
138	600809	山西汾酒	2,111,481.00	4.06
139	300038	数知科技	2,109,320.60	4.05
140	601992	金隅集团	2,097,650.00	4.03
141	000418	小天鹅 A	2,091,668.00	4.02
142	300431	暴风集团	2,084,260.00	4.00
143	002916	深南电路	2,078,119.00	3.99
144	600547	山东黄金	2,070,855.00	3.98
145	002798	帝欧家居	2,066,715.20	3.97
146	600332	白云山	2,062,621.99	3.96



147	300592	华凯创意	2,032,298.00	3.91
148	002463	沪电股份	2,024,852.00	3.89
149	002292	奥飞娱乐	2,022,630.52	3.89
150	002043	兔宝宝	2,009,949.12	3.86
151	002129	中环股份	2,007,941.64	3.86
152	603899	晨光文具	2,001,103.00	3.85
153	000702	正虹科技	1,996,081.00	3.84
154	300666	江丰电子	1,988,434.00	3.82
155	603363	傲农生物	1,983,401.00	3.81
156	600233	圆通速递	1,983,149.40	3.81
157	300732	设研院	1,981,041.00	3.81
158	600038	中直股份	1,975,127.76	3.80
159	000672	上峰水泥	1,969,620.00	3.78
160	603696	安记食品	1,964,397.70	3.77
161	300571	平治信息	1,958,575.00	3.76
162	601899	紫金矿业	1,949,800.00	3.75
163	603888	新华网	1,948,559.50	3.74
164	601212	白银有色	1,948,000.00	3.74
165	300081	恒信东方	1,946,850.00	3.74
166	600839	四川长虹	1,944,232.00	3.74
167	000933	神火股份	1,940,400.00	3.73
168	600239	云南城投	1,933,758.00	3.72
169	002189	中光学	1,903,887.51	3.66
170	603289	泰瑞机器	1,888,701.00	3.63
171	603811	诚意药业	1,887,825.00	3.63
172	600737	中粮糖业	1,887,608.00	3.63
173	600456	宝钛股份	1,885,600.00	3.62
174	000892	欢瑞世纪	1,881,007.00	3.61
175	601117	中国化学	1,873,024.00	3.60
176	300251	光线传媒	1,853,171.00	3.56
177	000538	云南白药	1,852,953.00	3.56
178	603317	天味食品	1,852,098.76	3.56
179	603297	永新光学	1,846,985.97	3.55
180	300098	高新兴	1,841,084.00	3.54
181	601138	工业富联	1,822,782.00	3.50
182	002384	东山精密	1,821,034.00	3.50
183	002439	启明星辰	1,814,804.00	3.49
184	000800	一汽轿车	1,785,179.00	3.43
185	601186	中国铁建	1,768,807.00	3.40
186	600030	中信证券	1,765,000.00	3.39
187	600640	号百控股	1,751,765.00	3.37
188	000783	长江证券	1,743,837.00	3.35
189	300033	同花顺	1,739,754.00	3.34
190	002507	涪陵榨菜	1,714,982.00	3.30

191	600216	浙江医药	1,712,036.00	3.29
192	600639	浦东金桥	1,707,235.98	3.28
193	002938	鹏鼎控股	1,693,833.00	3.25
194	601001	大同煤业	1,691,200.00	3.25
195	600497	驰宏锌锗	1,674,000.00	3.22
196	600967	内蒙一机	1,663,412.00	3.20
197	000911	*ST 南糖	1,657,402.00	3.18
198	601601	中国太保	1,641,117.74	3.15
199	601628	中国人寿	1,630,118.00	3.13
200	300759	康龙化成	1,619,672.36	3.11
201	601688	华泰证券	1,615,882.00	3.10
202	600549	厦门钨业	1,599,945.00	3.07
203	002661	克明面业	1,597,323.00	3.07
204	300702	天宇股份	1,585,906.20	3.05
205	002194	*ST 凡谷	1,575,592.00	3.03
206	601933	永辉超市	1,573,299.95	3.02
207	603737	三棵树	1,558,677.00	3.00
208	002368	太极股份	1,557,019.00	2.99
209	603083	剑桥科技	1,555,346.90	2.99
210	002531	天顺风能	1,548,797.00	2.98
211	002353	杰瑞股份	1,521,914.00	2.92
212	002831	裕同科技	1,521,599.00	2.92
213	300223	北京君正	1,518,702.26	2.92
214	002807	江阴银行	1,518,299.16	2.92
215	000768	中航飞机	1,510,500.00	2.90
216	600702	舍得酒业	1,502,428.00	2.89
217	603960	克来机电	1,490,814.66	2.86
218	603885	吉祥航空	1,485,398.00	2.85
219	300761	立华股份	1,480,025.86	2.84
220	600352	浙江龙盛	1,474,870.00	2.83
221	300395	菲利华	1,454,353.00	2.79
222	600622	光大嘉宝	1,453,353.00	2.79
223	600018	上港集团	1,440,700.00	2.77
224	600837	海通证券	1,437,443.00	2.76
225	300601	康泰生物	1,431,838.00	2.75
226	000066	中国长城	1,420,686.10	2.73
227	600875	东方电气	1,418,599.00	2.73
228	000002	万 科 A	1,415,000.00	2.72
229	603583	捷昌驱动	1,410,416.00	2.71
230	603068	博通集成	1,409,747.53	2.71
231	300681	英搏尔	1,398,846.00	2.69
232	603633	徕木股份	1,376,848.80	2.65
233	300184	力源信息	1,375,723.80	2.64
234	002171	楚江新材	1,373,518.00	2.64

235	002716	金贵银业	1,372,084.20	2.64
236	300171	东富龙	1,368,901.00	2.63
237	002010	传化智联	1,367,797.00	2.63
238	002041	登海种业	1,366,683.00	2.63
239	603501	韦尔股份	1,349,225.00	2.59
240	600458	时代新材	1,347,418.02	2.59
241	601600	中国铝业	1,333,398.00	2.56
242	000661	长春高新	1,330,000.00	2.56
243	002475	立讯精密	1,323,463.10	2.54
244	000928	中钢国际	1,312,118.00	2.52
245	300377	赢时胜	1,304,766.00	2.51
246	603118	共进股份	1,303,405.40	2.50
247	002522	浙江众成	1,301,650.00	2.50
248	300071	华谊嘉信	1,301,094.00	2.50
249	000802	北京文化	1,295,432.58	2.49
250	600276	恒瑞医药	1,274,862.60	2.45
251	603679	华体科技	1,274,166.00	2.45
252	300458	全志科技	1,273,135.00	2.45
253	002624	完美世界	1,269,487.00	2.44
254	300006	莱美药业	1,263,000.00	2.43
255	600037	歌华有线	1,261,570.00	2.42
256	601800	中国交建	1,260,211.00	2.42
257	300699	光威复材	1,255,046.00	2.41
258	603697	有友食品	1,254,745.48	2.41
259	000998	隆平高科	1,252,935.47	2.41
260	600895	张江高科	1,250,500.00	2.40
261	300094	国联水产	1,250,223.00	2.40
262	603218	日月股份	1,247,201.00	2.40
263	002449	国星光电	1,245,613.20	2.39
264	601012	隆基股份	1,225,000.00	2.35
265	600741	华域汽车	1,212,626.00	2.33
266	002697	红旗连锁	1,205,758.00	2.32
267	002341	新纶科技	1,200,000.00	2.31
268	002366	台海核电	1,191,711.00	2.29
269	000889	中嘉博创	1,172,762.00	2.25
270	601328	交通银行	1,163,700.00	2.24
271	300443	金雷股份	1,133,615.00	2.18
272	002304	洋河股份	1,128,268.00	2.17
273	002705	新宝股份	1,123,166.00	2.16
274	603103	横店影视	1,113,917.00	2.14
275	000789	万年青	1,108,461.00	2.13
276	300087	荃银高科	1,106,346.00	2.13
277	000651	格力电器	1,102,485.00	2.12
278	000976	华铁股份	1,066,000.00	2.05

279	000908	景峰医药	1,063,247.00	2.04
280	300373	扬杰科技	1,042,070.00	2.00

注：本项“买入金额”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。

#### 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	002714	牧原股份	13,361,164.10	25.67
2	002234	民和股份	10,054,470.00	19.32
3	000858	五粮液	9,069,162.02	17.43
4	000876	新希望	8,810,116.48	16.93
5	002124	天邦股份	8,320,102.70	15.99
6	000750	国海证券	8,020,911.00	15.41
7	002174	游族网络	7,635,505.00	14.67
8	601881	中国银河	7,580,093.12	14.57
9	000100	TCL 集团	7,350,000.00	14.12
10	300498	温氏股份	6,926,154.99	13.31
11	002343	慈文传媒	6,877,009.00	13.21
12	000063	中兴通讯	6,832,920.00	13.13
13	603019	中科曙光	6,690,101.00	12.86
14	000977	浪潮信息	6,592,471.77	12.67
15	600831	广电网络	6,516,437.95	12.52
16	000625	长安汽车	6,462,186.60	12.42
17	600977	中国电影	6,052,330.70	11.63
18	000725	京东方 A	5,769,000.00	11.09
19	002299	圣农发展	5,630,658.72	10.82
20	002405	四维图新	5,618,735.00	10.80
21	300657	弘信电子	5,545,215.90	10.66
22	002268	卫士通	5,498,132.00	10.56
23	603288	海天味业	5,495,795.60	10.56
24	000732	泰禾集团	5,469,331.03	10.51
25	300356	光一科技	5,469,171.17	10.51
26	300115	长盈精密	5,455,361.00	10.48
27	600588	用友网络	5,133,139.00	9.86
28	300659	中孚信息	5,124,377.00	9.85
29	601336	新华保险	5,120,136.10	9.84
30	002241	歌尔股份	5,115,750.69	9.83
31	600136	当代明诚	5,078,429.60	9.76
32	000729	燕京啤酒	5,068,052.00	9.74
33	002321	华英农业	5,065,020.00	9.73

34	600088	中视传媒	4,787,995.00	9.20
35	000156	华数传媒	4,782,930.47	9.19
36	603323	苏农银行	4,750,697.22	9.13
37	002929	润建股份	4,669,839.00	8.97
38	603825	华扬联众	4,637,997.74	8.91
39	002146	荣盛发展	4,617,868.00	8.87
40	000839	中信国安	4,603,000.00	8.84
41	002670	国盛金控	4,592,826.05	8.83
42	300569	天能重工	4,567,756.30	8.78
43	600958	东方证券	4,394,955.73	8.44
44	002100	天康生物	4,244,722.78	8.16
45	600779	水井坊	4,240,379.00	8.15
46	603609	禾丰牧业	4,107,983.00	7.89
47	600196	复星医药	4,076,441.50	7.83
48	002594	比亚迪	4,068,725.00	7.82
49	000728	国元证券	4,057,335.00	7.80
50	000921	海信家电	4,048,856.00	7.78
51	300655	晶瑞股份	3,942,238.29	7.58
52	300413	芒果超媒	3,910,322.32	7.51
53	600373	中文传媒	3,849,631.00	7.40
54	002238	天威视讯	3,806,814.64	7.31
55	600519	贵州茅台	3,793,372.00	7.29
56	600996	贵广网络	3,750,987.00	7.21
57	603000	人民网	3,664,919.00	7.04
58	300426	唐德影视	3,613,644.04	6.94
59	002157	正邦科技	3,609,757.00	6.94
60	300688	创业黑马	3,604,674.00	6.93
61	600559	老白干酒	3,580,602.00	6.88
62	600936	广西广电	3,579,709.00	6.88
63	600690	海尔智家	3,558,092.09	6.84
64	002867	周大生	3,552,410.28	6.83
65	600745	闻泰科技	3,513,737.00	6.75
66	603369	今世缘	3,382,806.64	6.50
67	000783	长江证券	3,353,545.00	6.44
68	600600	青岛啤酒	3,351,256.76	6.44
69	603078	江化微	3,328,725.30	6.40
70	600305	恒顺醋业	3,221,409.30	6.19
71	300027	华谊兄弟	3,219,468.83	6.19
72	000802	北京文化	3,195,723.00	6.14
73	600703	三安光电	3,172,400.00	6.10
74	600340	华夏幸福	3,122,603.10	6.00
75	300474	景嘉微	3,121,201.00	6.00
76	000799	酒鬼酒	3,113,348.30	5.98
77	600887	伊利股份	3,102,274.00	5.96

78	000917	电广传媒	3,073,071.00	5.90
79	601858	中国科传	2,974,120.00	5.71
80	603516	淳中科技	2,952,092.00	5.67
81	002371	北方华创	2,913,305.00	5.60
82	600801	华新水泥	2,875,605.00	5.53
83	600422	昆药集团	2,875,009.00	5.52
84	000560	我爱我家	2,858,856.40	5.49
85	600975	新五丰	2,832,110.31	5.44
86	000568	泸州老窖	2,831,440.00	5.44
87	600872	中炬高新	2,823,228.00	5.42
88	300686	智动力	2,791,259.00	5.36
89	600267	海正药业	2,787,974.00	5.36
90	002661	克明面业	2,785,156.10	5.35
91	002235	安妮股份	2,776,656.00	5.34
92	300058	蓝色光标	2,775,084.00	5.33
93	002461	珠江啤酒	2,751,831.00	5.29
94	600523	贵航股份	2,743,866.50	5.27
95	600699	均胜电子	2,728,674.00	5.24
96	601966	玲珑轮胎	2,705,100.00	5.20
97	300661	圣邦股份	2,677,511.00	5.14
98	600985	淮北矿业	2,650,106.00	5.09
99	300113	顺网科技	2,629,644.00	5.05
100	000665	湖北广电	2,611,328.72	5.02
101	000572	*ST 海马	2,568,514.80	4.94
102	600570	恒生电子	2,557,691.00	4.91
103	600637	东方明珠	2,466,500.00	4.74
104	000895	双汇发展	2,465,034.00	4.74
105	002341	新纶科技	2,455,631.00	4.72
106	002746	仙坛股份	2,414,928.80	4.64
107	601633	长城汽车	2,414,766.00	4.64
108	603888	新华网	2,413,790.00	4.64
109	002035	华帝股份	2,401,358.43	4.61
110	000676	智度股份	2,398,710.00	4.61
111	000671	阳光城	2,370,074.00	4.55
112	603444	吉比特	2,369,398.00	4.55
113	600233	圆通速递	2,332,519.76	4.48
114	601949	中国出版	2,324,204.00	4.47
115	002142	宁波银行	2,320,000.00	4.46
116	300182	捷成股份	2,313,933.34	4.45
117	002468	申通快递	2,296,294.00	4.41
118	000915	山大华特	2,290,646.00	4.40
119	300571	平治信息	2,255,365.00	4.33
120	600742	一汽富维	2,247,374.40	4.32
121	601555	东吴证券	2,242,681.50	4.31

122	002043	兔宝宝	2,234,500.00	4.29
123	601699	潞安环能	2,222,518.00	4.27
124	600383	金地集团	2,213,831.00	4.25
125	300043	星辉娱乐	2,206,000.00	4.24
126	600809	山西汾酒	2,200,331.25	4.23
127	300347	泰格医药	2,182,617.12	4.19
128	000960	锡业股份	2,174,403.87	4.18
129	600536	中国软件	2,156,000.00	4.14
130	300431	暴风集团	2,154,641.40	4.14
131	002916	深南电路	2,153,821.00	4.14
132	300081	恒信东方	2,114,251.00	4.06
133	601992	金隅集团	2,111,924.55	4.06
134	000418	小天鹅A	2,101,639.00	4.04
135	603696	安记食品	2,100,595.51	4.04
136	600737	中粮糖业	2,100,177.00	4.04
137	000559	万向钱潮	2,095,391.00	4.03
138	300592	华凯创意	2,089,826.93	4.02
139	002439	启明星辰	2,082,802.28	4.00
140	603317	天味食品	2,064,935.80	3.97
141	603083	剑桥科技	2,047,957.30	3.94
142	300556	丝路视觉	2,045,744.00	3.93
143	002458	益生股份	2,038,311.00	3.92
144	002463	沪电股份	1,991,327.44	3.83
145	000672	上峰水泥	1,976,170.00	3.80
146	002194	*ST 凡谷	1,974,007.95	3.79
147	601238	广汽集团	1,972,241.00	3.79
148	000892	欢瑞世纪	1,965,546.00	3.78
149	002129	中环股份	1,960,031.00	3.77
150	600239	云南城投	1,942,611.00	3.73
151	002798	帝欧家居	1,941,674.00	3.73
152	000702	正虹科技	1,939,783.00	3.73
153	000933	神火股份	1,926,000.00	3.70
154	002292	奥飞娱乐	1,924,080.00	3.70
155	300666	江丰电子	1,920,050.00	3.69
156	601117	中国化学	1,920,000.00	3.69
157	600456	宝钛股份	1,917,910.00	3.69
158	601212	白银有色	1,917,063.00	3.68
159	300732	设研院	1,914,112.00	3.68
160	603589	口子窖	1,881,148.00	3.61
161	603363	傲农生物	1,879,786.00	3.61
162	000800	一汽轿车	1,878,379.03	3.61
163	600030	中信证券	1,875,000.00	3.60
164	300038	数知科技	1,861,471.00	3.58
165	601688	华泰证券	1,838,000.00	3.53

166	600458	时代新材	1,818,278.00	3.49
167	002189	中光学	1,813,164.00	3.48
168	000538	云南白药	1,808,392.00	3.47
169	300146	汤臣倍健	1,804,124.00	3.47
170	300098	高新兴	1,797,577.13	3.45
171	300759	康龙化成	1,790,642.48	3.44
172	600839	四川长虹	1,767,400.00	3.40
173	002163	中航三鑫	1,764,564.29	3.39
174	002384	东山精密	1,752,291.00	3.37
175	300251	光线传媒	1,749,796.00	3.36
176	601138	工业富联	1,744,553.00	3.35
177	601186	中国铁建	1,708,575.00	3.28
178	000401	冀东水泥	1,703,704.20	3.27
179	603297	永新光学	1,690,282.00	3.25
180	300033	同花顺	1,681,473.00	3.23
181	603289	泰瑞机器	1,662,485.00	3.19
182	601601	中国太保	1,654,000.00	3.18
183	601066	中信建投	1,648,431.18	3.17
184	000911	*ST 南糖	1,643,364.89	3.16
185	600639	浦东金桥	1,642,905.00	3.16
186	002716	金贵银业	1,633,316.00	3.14
187	603517	绝味食品	1,633,043.00	3.14
188	002507	涪陵榨菜	1,626,026.00	3.12
189	002938	鹏鼎控股	1,623,203.00	3.12
190	300171	东富龙	1,615,500.00	3.10
191	603679	华体科技	1,610,500.00	3.09
192	600497	驰宏锌锗	1,599,000.00	3.07
193	002792	通宇通讯	1,593,747.00	3.06
194	603737	三棵树	1,580,199.70	3.04
195	300702	天宇股份	1,579,893.00	3.04
196	002807	江阴银行	1,573,800.00	3.02
197	002531	天顺风能	1,573,625.82	3.02
198	601628	中国人寿	1,571,724.00	3.02
199	300395	菲利华	1,570,086.00	3.02
200	002368	太极股份	1,563,417.00	3.00
201	300761	立华股份	1,553,801.44	2.99
202	600622	光大嘉宝	1,550,512.00	2.98
203	600216	浙江医药	1,545,776.00	2.97
204	600702	舍得酒业	1,536,945.00	2.95
205	603885	吉祥航空	1,535,612.20	2.95
206	600352	浙江龙盛	1,535,000.00	2.95
207	601933	永辉超市	1,525,200.00	2.93
208	600549	厦门钨业	1,522,339.00	2.93
209	600018	上港集团	1,522,000.00	2.92



210	300377	赢时胜	1,516,763.50	2.91
211	000768	中航飞机	1,512,000.00	2.91
212	002353	杰瑞股份	1,498,263.00	2.88
213	601001	大同煤业	1,494,210.00	2.87
214	603636	南威软件	1,483,195.00	2.85
215	002041	登海种业	1,481,683.00	2.85
216	300601	康泰生物	1,470,740.00	2.83
217	000661	长春高新	1,470,012.00	2.82
218	603960	克来机电	1,460,266.69	2.81
219	600640	号百控股	1,440,080.00	2.77
220	600875	东方电气	1,432,693.00	2.75
221	300223	北京君正	1,421,069.00	2.73
222	000066	中国长城	1,420,000.00	2.73
223	002831	裕同科技	1,413,909.00	2.72
224	300681	英搏尔	1,410,965.00	2.71
225	000928	中钢国际	1,405,112.00	2.70
226	600837	海通证券	1,400,000.00	2.69
227	300006	莱美药业	1,386,553.00	2.66
228	000002	万 科 A	1,380,294.46	2.65
229	300071	华谊嘉信	1,372,794.00	2.64
230	300699	光威复材	1,371,322.00	2.63
231	601600	中国铝业	1,364,000.00	2.62
232	603118	共进股份	1,362,000.00	2.62
233	002171	楚江新材	1,360,239.00	2.61
234	000889	中嘉博创	1,356,572.00	2.61
235	603218	日月股份	1,351,221.00	2.60
236	601952	苏垦农发	1,326,530.40	2.55
237	002010	传化智联	1,321,997.00	2.54
238	603633	徕木股份	1,313,080.90	2.52
239	300654	世纪天鸿	1,299,253.00	2.50
240	600276	恒瑞医药	1,298,913.00	2.50
241	002449	国星光电	1,292,420.90	2.48
242	601800	中国交建	1,288,500.00	2.48
243	002705	新宝股份	1,284,498.00	2.47
244	002475	立讯精密	1,282,954.00	2.47
245	300094	国联水产	1,270,000.00	2.44
246	601021	春秋航空	1,257,173.00	2.42
247	601012	隆基股份	1,250,686.87	2.40
248	300184	力源信息	1,250,000.00	2.40
249	002522	浙江众成	1,244,000.00	2.39
250	603697	有友食品	1,238,237.00	2.38
251	600037	歌华有线	1,236,000.00	2.37
252	002624	完美世界	1,232,726.00	2.37
253	603501	韦尔股份	1,225,088.00	2.35

254	300458	全志科技	1,219,540.00	2.34
255	600895	张江高科	1,203,224.00	2.31
256	002697	红旗连锁	1,200,382.00	2.31
257	002567	唐人神	1,178,873.00	2.27
258	603583	捷昌驱动	1,173,000.00	2.25
259	002304	洋河股份	1,167,674.00	2.24
260	600741	华域汽车	1,163,464.00	2.24
261	600882	妙可蓝多	1,161,734.00	2.23
262	601328	交通银行	1,161,000.00	2.23
263	300003	乐普医疗	1,159,951.00	2.23
264	600804	鹏博士	1,158,421.00	2.23
265	600990	四创电子	1,154,795.00	2.22
266	002366	台海核电	1,145,307.00	2.20
267	300443	金雷股份	1,121,374.00	2.15
268	000998	隆平高科	1,118,958.18	2.15
269	000789	万年青	1,112,186.00	2.14
270	603103	横店影视	1,111,600.00	2.14
271	000908	景峰医药	1,093,211.26	2.10
272	300373	扬杰科技	1,089,144.26	2.09
273	000651	格力电器	1,064,615.74	2.05
274	300326	凯利泰	1,056,467.00	2.03
275	000976	华铁股份	1,050,150.00	2.02
276	600332	白云山	1,045,714.00	2.01

注：本项“卖出金额”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。

#### 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	817,359,439.82
卖出股票的收入（成交）总额	811,272,261.41

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。

#### 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。

**7.7 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明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**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。

**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**

本报告期末本基金无股指期货投资。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

**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**

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本报告期末本基金无国债期货投资。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本报告期末本基金无国债期货投资。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 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。

7.12.2 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

**7.12.3 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	156,386.18
2	应收证券清算款	745,124.43

3	应收股利	-
4	应收利息	1,210.74
5	应收申购款	14,699.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	917,421.31

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 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
4,563	10,624.68	0.00	0.00%	48,480,394.59	100.00%

### 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	62,095.91	0.13%

**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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2011 年 1 月 28 日）基金份额总额	742,965,884.43
本报告期期初基金份额总额	45,521,401.60
本报告期基金总申购份额	23,303,431.02
减：本报告期基金总赎回份额	20,344,438.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	48,480,394.59

**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，担任总经理。

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。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

**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 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

## 10.6 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	546,984,758.10	33.61%	400,011.14	32.11%	-
恒泰证券	2	426,202,580.19	26.19%	311,681.15	25.02%	-
太平洋证券	2	146,118,091.22	8.98%	106,856.49	8.58%	-
中信建投证券	1	113,147,670.49	6.95%	82,744.84	6.64%	-
国金证券	1	77,943,457.22	4.79%	72,590.12	5.83%	-
国信证券	1	74,137,220.76	4.56%	69,044.51	5.54%	-
安信证券	1	67,287,933.47	4.13%	49,207.71	3.95%	-
银河证券	1	60,622,477.50	3.72%	56,457.73	4.53%	-
渤海证券	1	58,914,305.64	3.62%	54,867.31	4.40%	-
广发证券	1	50,490,759.71	3.10%	36,924.34	2.96%	-
申银万国	1	5,662,714.00	0.35%	5,273.74	0.42%	-

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 15 个交易席位，其中报告期内新增 0 个交易席位，退租 0 个交易席位。

#### 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。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他信息。

新华基金管理股份有限公司

二〇一九年八月二十四日