

新华外延增长主题灵活配置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	新华外延增长主题灵活配置混合
基金主代码	003238
交易代码	003238
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月2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	64,407,919.46 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	重点关注国家产业升级发展过程中带来的投资机会，综合运用多种投资策略，精选外延增长主题的优质企业进行投资，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上，力争为投资人提供长期稳定的回报。
投资策略	投资策略方面，本基金将以大类资产配置策略为基础，采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。大类资产配置策略主要运用战略性资产配置策略和战术性资产配置策略。股票投资策略指通过对外延增长主题个股的持续跟踪，以研究员以及基金经理的实地调研、密切跟踪以及扎实的案头分析工作为基础，采用自上而下与自下而上相结合的选股策略，动态精选能够充分受益于外延增长为主题的优质股票进行投资。具体运作方法包括外延增长主题相关股票的界定和个股挖掘等方法。债券投资策略主要运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略等。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	26,051,531.65
本期利润	27,436,716.91
加权平均基金份额本期利润	0.4068
本期基金份额净值增长率	38.96%
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	0.1068
期末基金资产净值	71,287,662.70
期末基金份额净值	1.1068

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	1.77%	1.37%	2.78%	0.70%	-1.01%	0.67%
过去三个月	-4.01%	1.82%	-2.19%	0.93%	-1.82%	0.89%
过去六个月	38.96%	1.87%	14.61%	0.93%	24.35%	0.94%
过去一年	20.90%	1.80%	5.07%	0.91%	15.83%	0.89%
自基金合同生效起至今	10.68%	1.43%	2.45%	0.72%	8.23%	0.71%

注：1、本基金于 2017 年 3 月 2 日基金合同生效；

2、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中证 800 指数收益率，债券投资部分的业绩比较基

准选择中国债券总指数收益率，复合业绩比较基准为 $60\% \times$ 中证 800 指数收益率 $+40\% \times$ 中国债券总指数收益率。

3、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

新华外延增长主题灵活配置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
 (2017 年 3 月 2 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：本报告期，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		
付伟	本基金基金经理，新华中小市值优选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。	2017-03-02	-	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外延增长主题灵活配置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》、《新华外延增长主题灵活配置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所对手询价、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，注重自下而上选股，精选符合外延增长主题的个股，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 1.1068 元，本报告期份额净值增长率为 38.96%，同期比较基准的增长率为 14.61%。

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：新华外延增长主题灵活配置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	4,590,864.58	13,461,619.65
结算备付金	605,897.18	1,025,630.51
存出保证金	153,659.60	130,639.43
交易性金融资产	66,613,396.93	60,117,575.52
其中：股票投资	66,613,396.93	60,117,575.52
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	1,390,476.01	1,544,535.74
应收利息	1,144.87	2,865.18
应收股利	-	-
应收申购款	13,467.82	991.86
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	73,368,906.99	76,283,857.89
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	396,686.51	4,557,232.67
应付赎回款	188,333.57	-
应付管理人报酬	83,600.51	93,763.88
应付托管费	13,933.42	15,627.30
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,310,012.04	620,867.24
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	88,678.24	460,000.00
负债合计	2,081,244.29	5,747,491.09
所有者权益：	-	-
实收基金	64,407,919.46	88,558,783.60

未分配利润	6,879,743.24	-18,022,416.80
所有者权益合计	71,287,662.70	70,536,366.80
负债和所有者权益总计	73,368,906.99	76,283,857.89

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1068 元，基金份额总额 64,407,919.46 份。

6.2 利润表

会计主体：新华外延增长主题灵活配置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
一、收入	30,309,028.94	11,542,578.85
1.利息收入	46,929.41	72,554.98
其中：存款利息收入	46,929.41	72,554.98
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）	28,803,688.01	8,276,644.10
其中：股票投资收益	28,550,807.24	7,963,670.59
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	252,880.77	312,973.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,385,185.26	3,170,145.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	73,226.26	23,234.70
减：二、费用	2,872,312.03	5,349,742.56
1. 管理人报酬	509,963.02	993,138.46
2. 托管费	84,993.84	165,523.10
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,174,586.34	3,946,518.14
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	102,768.83	244,562.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	27,436,716.91	6,192,836.29
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	27,436,716.91	6,192,836.29

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华外延增长主题灵活配置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）	88,558,783.60	-18,022,416.80	70,536,366.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,436,716.91	27,436,716.91
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）	-24,150,864.14	-2,534,556.87	-26,685,421.01
其中：1.基金申购款	40,084,247.50	5,715,058.86	45,799,306.36
2.基金赎回款	-64,235,111.64	-8,249,615.73	-72,484,727.37
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）	64,407,919.46	6,879,743.24	71,287,662.70
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）	200,943,185.93	-9,827,046.08	191,116,139.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,192,836.29	6,192,836.29
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）	-107,627,338.09	-4,253,542.50	-111,880,880.59
其中：1.基金申购款	9,310,238.66	-406,625.54	8,903,613.12
2.基金赎回款	-116,937,576.75	-3,846,916.96	-120,784,493.71
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）	93,315,847.84	-7,887,752.29	85,428,095.55

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

新华外延增长主题灵活配置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[2016]1724 号文准予注册，由新华基金管理股份有限公司发起募集的契约型开放式基金，于 2017 年 1 月 23 日至 2 月 24 日向社会公开募集，首次募集资金总额 432,690,734.09 元，其中募集净认购资金金额 432,628,673.66 元，募集资金产生利息 62,060.43 元，并经瑞华会计师事务所有限公司瑞华验字[2017]第 01360008 号验资报告予以验证。2017 年 3 月 2 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，存续期不设定，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《新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金及到期日在一年以内的政府债券等，以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)。本基金股票资产投资比例为基金资产的 0—95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券，投资于外延增长主题的证券资产不低于本基金非现金基金资产的 80%。本基金所指的外延增长主要指上市公司通过并购重组实现企业生产经营规模的迅速扩张和业务领域的多元化拓展，所界定外延增长主题的股票为已经实施、正在进行外延增长或通过分析有外延增长预期的发行上市股票。

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，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日发布的《企业会计准则——基本准则》、及其后颁布和修订的 41 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》、《新华外延增长主题灵活配置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有关信息。

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估计与最近一期年度报告相一致，所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

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

本基金报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期末未发生差错更正。

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《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。

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。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	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	420,834,963.90	26.32%	791,680,712.76	27.31%

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的债券交易。

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的债券回购交易。

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	307,757.87	25.21%	307,757.87	23.49%
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	578,958.10	26.05%	135,557.44	14.84%

司				
---	--	--	--	--

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	509,963.02	993,138.46
其中：支付销售机构的客户维护费	249,784.63	597,542.65

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。

6.4.8.2.2 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	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托管费	84,993.84	165,523.10

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

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方进行银行间同业市场的债券（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

报告期内，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	4,590,864.58	34,620.40	8,730,625.76	52,941.42

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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

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

报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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**

报告期末，本基金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

报告期末，本基金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	66,613,396.93	90.79
	其中：股票	66,613,396.93	90.79
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	5,196,761.76	7.08
7	其他各项资产	1,558,748.30	2.12
8	合计	73,368,906.99	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	3,038,002.65	4.26
C	制造业	41,998,231.44	58.91
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	1,531,500.00	2.15
G	交通运输、仓储和邮政业	2,184,000.00	3.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,719,592.90	19.25
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	4,108,200.00	5.76
S	综合	-	-
	合计	66,613,396.93	93.44

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	600588	用友网络	160,050	4,302,144.00	6.03
2	601633	长城汽车	360,000	2,977,200.00	4.18
3	600760	中航沈飞	100,000	2,903,000.00	4.07
4	000858	五粮液	24,000	2,830,800.00	3.97
5	002371	北方华创	40,000	2,770,000.00	3.89
6	600570	恒生电子	40,000	2,726,000.00	3.82
7	002157	正邦科技	160,000	2,665,600.00	3.74
8	000063	中兴通讯	80,000	2,602,400.00	3.65
9	600584	长电科技	200,000	2,570,000.00	3.61
10	601949	中国出版	390,000	2,535,000.00	3.56

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	000858	五 粮 液	11,776,539.00	16.70
2	600570	恒生电子	9,113,728.24	12.92
3	600519	贵州茅台	9,066,347.00	12.85
4	002234	民和股份	8,434,077.00	11.96
5	600996	贵广网络	7,859,641.60	11.14
6	000750	国海证券	7,697,758.00	10.91
7	002343	慈文传媒	7,523,458.00	10.67
8	600831	广电网络	7,165,938.06	10.16
9	603288	海天味业	7,130,393.78	10.11
10	600958	东方证券	6,803,748.53	9.65
11	002371	北方华创	6,760,792.00	9.58
12	300498	温氏股份	6,692,227.17	9.49
13	601881	中国银河	6,609,106.13	9.37
14	002174	游族网络	6,599,539.68	9.36
15	002714	牧原股份	6,436,283.80	9.12
16	002405	四维图新	6,431,355.54	9.12
17	600030	中信证券	6,214,800.00	8.81
18	000625	长安汽车	6,204,069.00	8.80
19	000732	泰禾集团	6,193,711.00	8.78
20	000876	新 希 望	6,121,845.00	8.68
21	601949	中国出版	5,990,199.70	8.49
22	000100	TCL 集团	5,949,064.00	8.43
23	000063	中兴通讯	5,896,848.00	8.36
24	002146	荣盛发展	5,805,675.00	8.23
25	600588	用友网络	5,801,879.30	8.23
26	600887	伊利股份	5,615,807.00	7.96
27	000002	万 科 A	5,450,022.96	7.73
28	600600	青岛啤酒	5,426,314.96	7.69
29	300356	光一科技	5,177,896.00	7.34
30	603019	中科曙光	5,176,324.20	7.34
31	002241	歌尔股份	5,152,368.00	7.30
32	600977	中国电影	5,142,374.00	7.29
33	601858	中国科传	5,115,479.40	7.25
34	300657	弘信电子	5,020,545.00	7.12
35	300027	华谊兄弟	4,983,286.00	7.06
36	002268	卫 士 通	4,971,952.80	7.05

37	601336	新华保险	4,931,598.00	6.99
38	600136	当代明诚	4,890,159.60	6.93
39	002238	天威视讯	4,880,821.20	6.92
40	603323	苏农银行	4,856,643.00	6.89
41	600088	中视传媒	4,764,255.77	6.75
42	600196	复星医药	4,740,281.00	6.72
43	000728	国元证券	4,733,359.66	6.71
44	600690	海尔智家	4,566,007.72	6.47
45	002157	正邦科技	4,478,230.00	6.35
46	600340	华夏幸福	4,455,661.34	6.32
47	601238	广汽集团	4,313,552.20	6.12
48	000651	格力电器	4,284,431.00	6.07
49	000977	浪潮信息	4,272,687.82	6.06
50	601633	长城汽车	4,160,070.96	5.90
51	002670	国盛金控	4,140,742.00	5.87
52	300569	天能重工	4,079,217.00	5.78
53	000839	中信国安	4,041,780.00	5.73
54	600760	中航沈飞	3,996,207.00	5.67
55	603160	汇顶科技	3,984,870.71	5.65
56	600584	长电科技	3,984,116.00	5.65
57	000729	燕京啤酒	3,975,740.90	5.64
58	000799	酒鬼酒	3,888,878.00	5.51
59	603369	今世缘	3,873,682.00	5.49
60	601555	东吴证券	3,861,689.00	5.47
61	600703	三安光电	3,789,764.00	5.37
62	300115	长盈精密	3,779,753.44	5.36
63	600975	新五丰	3,748,240.00	5.31
64	000895	双汇发展	3,734,278.00	5.29
65	600872	中炬高新	3,641,410.60	5.16
66	000725	京东方 A	3,594,000.00	5.10
67	300251	光线传媒	3,513,818.68	4.98
68	000665	湖北广电	3,504,742.00	4.97
69	600779	水井坊	3,470,506.00	4.92
70	603825	华扬联众	3,430,069.80	4.86
71	000401	冀东水泥	3,419,269.00	4.85
72	002458	益生股份	3,232,375.90	4.58
73	002124	天邦股份	3,226,420.15	4.57
74	600745	闻泰科技	3,159,932.00	4.48
75	603516	淳中科技	3,134,832.20	4.44
76	300686	智动力	3,118,011.00	4.42
77	300688	创业黑马	3,087,988.00	4.38
78	600742	一汽富维	3,071,654.56	4.35
79	600536	中国软件	3,067,618.00	4.35
80	300571	平治信息	3,020,203.00	4.28

81	600422	昆药集团	2,965,671.42	4.20
82	000568	泸州老窖	2,949,180.11	4.18
83	600809	山西汾酒	2,946,958.00	4.18
84	000572	*ST 海马	2,929,991.00	4.15
85	600559	老白干酒	2,904,907.00	4.12
86	600383	金地集团	2,815,372.09	3.99
87	002100	天康生物	2,799,580.52	3.97
88	002461	珠江啤酒	2,770,344.00	3.93
89	603589	口子窖	2,770,221.00	3.93
90	600267	海正药业	2,749,909.00	3.90
91	002929	润建股份	2,731,495.00	3.87
92	300426	唐德影视	2,697,121.21	3.82
93	300431	暴风集团	2,673,685.64	3.79
94	002594	比亚迪	2,673,346.00	3.79
95	601699	潞安环能	2,664,484.78	3.78
96	300413	芒果超媒	2,647,362.00	3.75
97	603517	绝味食品	2,631,698.00	3.73
98	603609	禾丰牧业	2,597,785.33	3.68
99	600523	贵航股份	2,527,565.20	3.58
100	600985	淮北矿业	2,516,601.00	3.57
101	600801	华新水泥	2,483,144.28	3.52
102	603888	新华网	2,479,964.00	3.52
103	603000	人民网	2,476,040.00	3.51
104	000917	电广传媒	2,451,936.00	3.48
105	601186	中国铁建	2,406,247.00	3.41
106	000889	中嘉博创	2,402,649.00	3.41
107	600637	东方明珠	2,398,321.00	3.40
108	000878	云南铜业	2,388,244.97	3.39
109	300058	蓝色光标	2,364,751.00	3.35
110	601318	中国平安	2,358,950.00	3.34
111	600875	东方电气	2,358,040.43	3.34
112	603696	安记食品	2,355,626.71	3.34
113	000156	华数传媒	2,335,239.00	3.31
114	601899	紫金矿业	2,322,000.00	3.29
115	600640	号百控股	2,302,015.00	3.26
116	603833	欧派家居	2,299,170.00	3.26
117	002321	华英农业	2,282,740.00	3.24
118	002120	韵达股份	2,197,678.00	3.12
119	002035	华帝股份	2,179,678.50	3.09
120	300146	汤臣倍健	2,169,511.00	3.08
121	300556	丝路视觉	2,167,921.64	3.07
122	002202	金风科技	2,166,921.00	3.07
123	000400	许继电气	2,161,961.00	3.07
124	600004	白云机场	2,160,824.55	3.06

125	600298	安琪酵母	2,124,683.10	3.01
126	300699	光威复材	2,090,988.00	2.96
127	300003	乐普医疗	2,080,615.00	2.95
128	002798	帝欧家居	2,076,249.00	2.94
129	600804	鹏博士	2,064,000.00	2.93
130	600895	张江高科	2,061,538.00	2.92
131	002624	完美世界	2,044,967.92	2.90
132	002299	圣农发展	2,044,625.00	2.90
133	600233	圆通速递	1,999,810.00	2.84
134	600038	中直股份	1,977,376.00	2.80
135	000676	智度股份	1,975,932.00	2.80
136	300732	设研院	1,964,347.00	2.78
137	000672	上峰水泥	1,962,813.00	2.78
138	600352	浙江龙盛	1,961,175.00	2.78
139	000960	锡业股份	1,954,785.14	2.77
140	603515	欧普照明	1,946,821.61	2.76
141	603297	永新光学	1,940,387.00	2.75
142	603538	美诺华	1,907,500.60	2.70
143	002807	江阴银行	1,904,272.74	2.70
144	000933	神火股份	1,899,812.00	2.69
145	603363	傲农生物	1,897,467.00	2.69
146	603811	诚意药业	1,894,084.00	2.69
147	601800	中国交建	1,887,154.00	2.68
148	600737	中粮糖业	1,886,436.00	2.67
149	002867	周大生	1,873,335.00	2.66
150	601117	中国化学	1,870,581.00	2.65
151	002705	新宝股份	1,862,351.33	2.64
152	600585	海螺水泥	1,852,725.00	2.63
153	000538	云南白药	1,851,794.00	2.63
154	603317	天味食品	1,818,092.65	2.58
155	600702	舍得酒业	1,814,017.14	2.57
156	603697	有友食品	1,798,695.63	2.55
157	603679	华体科技	1,788,959.00	2.54
158	002366	台海核电	1,787,747.00	2.53
159	600458	时代新材	1,784,973.00	2.53
160	000997	新大陆	1,764,534.00	2.50
161	300770	新媒股份	1,748,643.08	2.48
162	600720	祁连山	1,743,629.00	2.47
163	600639	浦东金桥	1,736,629.00	2.46
164	002235	安妮股份	1,710,397.50	2.42
165	000921	海信家电	1,704,735.10	2.42
166	600456	宝钛股份	1,701,582.00	2.41
167	300038	数知科技	1,698,252.80	2.41
168	002163	中航三鑫	1,686,616.00	2.39

169	601992	金隅集团	1,677,975.43	2.38
170	600867	通化东宝	1,667,553.00	2.36
171	601138	工业富联	1,652,066.00	2.34
172	601688	华泰证券	1,645,800.00	2.33
173	603929	亚翔集成	1,595,724.99	2.26
174	601100	恒立液压	1,580,325.00	2.24
175	000821	京山轻机	1,577,261.00	2.24
176	000802	北京文化	1,572,077.00	2.23
177	601933	永辉超市	1,566,079.00	2.22
178	002341	新纶科技	1,562,666.00	2.22
179	600037	歌华有线	1,556,765.00	2.21
180	300009	安科生物	1,553,701.32	2.20
181	002548	金新农	1,544,368.00	2.19
182	600373	中文传媒	1,543,300.00	2.19
183	600741	华域汽车	1,533,862.04	2.17
184	601128	常熟银行	1,527,290.00	2.17
185	600936	广西广电	1,525,597.00	2.16
186	300750	宁德时代	1,521,986.00	2.16
187	000800	一汽轿车	1,517,734.00	2.15
188	600115	东方航空	1,510,000.00	2.14
189	603985	恒润股份	1,509,392.12	2.14
190	300223	北京君正	1,506,810.28	2.14
191	000671	阳光城	1,482,216.00	2.10
192	300661	圣邦股份	1,479,120.00	2.10
193	601212	白银有色	1,473,000.00	2.09
194	300601	康泰生物	1,448,649.00	2.05
195	000418	小天鹅 A	1,444,923.00	2.05
196	600837	海通证券	1,437,600.00	2.04
197	000559	万向钱潮	1,434,012.60	2.03
198	000066	中国长城	1,427,960.10	2.02
199	603583	捷昌驱动	1,416,373.00	2.01
200	601066	中信建投	1,411,503.00	2.00
201	002142	宁波银行	1,411,177.38	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	600570	恒生电子	11,321,641.29	16.05
2	002714	牧原股份	11,117,124.70	15.76

3	000858	五 粮 液	9,571,600.95	13.57
4	000876	新 希 望	9,342,016.01	13.24
5	002343	慈文传媒	8,801,720.92	12.48
6	002174	游族网络	8,155,276.16	11.56
7	000750	国海证券	7,880,552.00	11.17
8	002234	民和股份	7,820,797.66	11.09
9	600519	贵州茅台	7,543,797.00	10.69
10	603288	海天味业	7,387,258.34	10.47
11	600831	广电网络	7,385,685.03	10.47
12	300498	温氏股份	7,324,929.00	10.38
13	600977	中国电影	7,249,584.91	10.28
14	600030	中信证券	7,054,187.00	10.00
15	000063	中兴通讯	6,918,664.00	9.81
16	000732	泰禾集团	6,623,499.52	9.39
17	600958	东方证券	6,561,226.80	9.30
18	000977	浪潮信息	6,482,965.30	9.19
19	000100	TCL 集团	6,362,400.00	9.02
20	000625	长安汽车	6,297,068.73	8.93
21	601881	中国银河	6,265,193.00	8.88
22	600996	贵广网络	6,063,708.35	8.60
23	603019	中科曙光	5,934,107.00	8.41
24	002146	荣盛发展	5,858,717.00	8.31
25	600600	青岛啤酒	5,850,872.11	8.29
26	300356	光一科技	5,807,589.00	8.23
27	600887	伊利股份	5,794,675.00	8.22
28	300657	弘信电子	5,624,290.00	7.97
29	002299	圣农发展	5,505,828.18	7.81
30	002268	卫 士 通	5,469,065.00	7.75
31	000002	万 科 A	5,428,045.24	7.70
32	600088	中视传媒	5,398,533.80	7.65
33	601336	新华保险	5,004,679.00	7.10
34	000728	国元证券	4,972,118.97	7.05
35	002238	天威视讯	4,971,603.20	7.05
36	300027	华谊兄弟	4,881,403.94	6.92
37	603323	苏农银行	4,871,783.19	6.91
38	600136	当代明诚	4,818,790.00	6.83
39	002241	歌尔股份	4,800,920.00	6.81
40	601949	中国出版	4,768,153.28	6.76
41	002405	四维图新	4,648,763.00	6.59
42	600196	复星医药	4,637,734.00	6.57
43	300115	长盈精密	4,530,202.00	6.42
44	600340	华夏幸福	4,528,727.69	6.42
45	600703	三安光电	4,513,419.00	6.40
46	300413	芒果超媒	4,503,793.28	6.39

47	600690	海尔智家	4,483,630.00	6.36
48	603160	汇顶科技	4,429,369.20	6.28
49	000729	燕京啤酒	4,341,508.00	6.15
50	603000	人民网	4,271,656.00	6.06
51	300251	光线传媒	4,269,008.43	6.05
52	000799	酒鬼酒	4,265,550.00	6.05
53	600588	用友网络	4,215,460.25	5.98
54	000651	格力电器	4,207,010.00	5.96
55	300569	天能重工	4,177,357.90	5.92
56	000839	中信国安	4,117,154.00	5.84
57	000802	北京文化	4,110,932.89	5.83
58	002371	北方华创	4,069,007.00	5.77
59	601555	东吴证券	4,060,671.00	5.76
60	603369	今世缘	4,011,151.00	5.69
61	002929	润建股份	3,974,888.00	5.64
62	002670	国盛金控	3,899,969.00	5.53
63	600872	中炬高新	3,773,979.00	5.35
64	000895	双汇发展	3,689,891.00	5.23
65	600975	新五丰	3,687,592.00	5.23
66	300347	泰格医药	3,585,016.00	5.08
67	000665	湖北广电	3,578,566.63	5.07
68	300003	乐普医疗	3,574,064.00	5.07
69	002157	正邦科技	3,574,052.27	5.07
70	601858	中国科传	3,538,919.00	5.02
71	000725	京东方 A	3,456,000.00	4.90
72	600745	闻泰科技	3,437,380.00	4.87
73	600779	水井坊	3,364,996.76	4.77
74	603888	新华网	3,357,127.00	4.76
75	002124	天邦股份	3,345,703.00	4.74
76	002100	天康生物	3,259,964.00	4.62
77	600559	老白干酒	3,242,538.38	4.60
78	603825	华扬联众	3,211,869.60	4.55
79	603516	淳中科技	3,204,161.80	4.54
80	300571	平治信息	3,179,123.00	4.51
81	600809	山西汾酒	3,129,882.00	4.44
82	300686	智动力	3,126,814.00	4.43
83	600373	中文传媒	3,044,367.84	4.32
84	600742	一汽富维	2,970,249.64	4.21
85	601688	华泰证券	2,936,600.00	4.16
86	000568	泸州老窖	2,932,787.00	4.16
87	603609	禾丰牧业	2,919,196.00	4.14
88	600422	昆药集团	2,902,609.00	4.12
89	601238	广汽集团	2,886,219.20	4.09
90	002594	比亚迪	2,882,968.00	4.09

91	300688	创业黑马	2,866,712.00	4.06
92	600523	贵航股份	2,864,144.00	4.06
93	300431	暴风集团	2,852,620.80	4.04
94	002321	华英农业	2,799,079.00	3.97
95	600267	海正药业	2,796,681.68	3.96
96	600383	金地集团	2,758,626.00	3.91
97	002458	益生股份	2,742,849.00	3.89
98	000889	中嘉博创	2,721,245.55	3.86
99	002461	珠江啤酒	2,651,736.00	3.76
100	002202	金风科技	2,589,922.80	3.67
101	601699	潞安环能	2,583,155.00	3.66
102	300426	唐德影视	2,580,217.50	3.66
103	000917	电广传媒	2,556,540.00	3.62
104	000572	*ST 海马	2,516,500.00	3.57
105	600985	淮北矿业	2,516,321.23	3.57
106	603696	安记食品	2,511,890.20	3.56
107	600801	华新水泥	2,509,501.00	3.56
108	300059	东方财富	2,454,930.98	3.48
109	000783	长江证券	2,453,612.00	3.48
110	600637	东方明珠	2,442,393.55	3.46
111	600458	时代新材	2,434,014.00	3.45
112	601318	中国平安	2,403,226.77	3.41
113	000878	云南铜业	2,377,529.00	3.37
114	600875	东方电气	2,361,891.63	3.35
115	600233	圆通速递	2,338,908.60	3.32
116	600804	鹏博士	2,320,915.00	3.29
117	601186	中国铁建	2,283,030.00	3.24
118	000400	许继电气	2,273,313.00	3.22
119	603679	华体科技	2,254,700.00	3.20
120	300058	蓝色光标	2,244,852.00	3.18
121	000156	华数传媒	2,238,025.00	3.17
122	600073	上海梅林	2,229,102.00	3.16
123	002129	中环股份	2,198,719.00	3.12
124	600640	号百控股	2,183,495.00	3.10
125	002120	韵达股份	2,175,170.00	3.08
126	300699	光威复材	2,152,344.30	3.05
127	002035	华帝股份	2,142,091.25	3.04
128	002705	新宝股份	2,132,900.50	3.02
129	601019	山东出版	2,122,029.02	3.01
130	300770	新媒股份	2,104,733.45	2.98
131	600737	中粮糖业	2,096,257.00	2.97
132	603636	南威软件	2,073,413.57	2.94
133	002867	周大生	2,071,362.82	2.94
134	002624	完美世界	2,067,283.87	2.93

135	603317	天味食品	2,065,236.51	2.93
136	600352	浙江龙盛	2,054,819.31	2.91
137	600038	中直股份	2,053,386.80	2.91
138	300556	丝路视觉	2,022,812.00	2.87
139	603515	欧普照明	1,996,890.80	2.83
140	000676	智度股份	1,989,327.00	2.82
141	002796	世嘉科技	1,987,357.00	2.82
142	002798	帝欧家居	1,982,413.40	2.81
143	000672	上峰水泥	1,978,842.00	2.81
144	600895	张江高科	1,974,688.78	2.80
145	603538	美诺华	1,955,015.00	2.77
146	002807	江阴银行	1,953,000.00	2.77
147	000960	锡业股份	1,950,374.00	2.77
148	601800	中国交建	1,926,866.00	2.73
149	600585	海螺水泥	1,925,402.00	2.73
150	002792	通宇通讯	1,922,635.75	2.73
151	601117	中国化学	1,920,317.00	2.72
152	300732	设研院	1,912,245.00	2.71
153	603363	傲农生物	1,872,124.48	2.65
154	000933	神火股份	1,843,116.00	2.61
155	600720	祁连山	1,827,001.00	2.59
156	603083	剑桥科技	1,825,038.00	2.59
157	603297	永新光学	1,814,283.00	2.57
158	000538	云南白药	1,806,217.00	2.56
159	000921	海信家电	1,776,222.00	2.52
160	603697	有友食品	1,770,458.44	2.51
161	000997	新大陆	1,767,335.66	2.51
162	600702	舍得酒业	1,767,051.00	2.51
163	300146	汤臣倍健	1,761,622.00	2.50
164	600456	宝钛股份	1,759,599.15	2.49
165	002302	西部建设	1,724,000.00	2.44
166	600305	恒顺醋业	1,722,993.87	2.44
167	002366	台海核电	1,718,074.00	2.44
168	000401	冀东水泥	1,705,491.94	2.42
169	603929	亚翔集成	1,685,457.00	2.39
170	000800	一汽轿车	1,678,135.06	2.38
171	601992	金隅集团	1,670,000.00	2.37
172	002235	安妮股份	1,663,451.00	2.36
173	600597	光明乳业	1,663,100.00	2.36
174	300750	宁德时代	1,640,078.00	2.33
175	600639	浦东金桥	1,630,029.00	2.31
176	002746	仙坛股份	1,608,721.10	2.28
177	300171	东富龙	1,605,600.00	2.28
178	603444	吉比特	1,595,067.00	2.26

179	002385	大北农	1,590,000.00	2.25
180	601138	工业富联	1,588,239.78	2.25
181	000671	阳光城	1,578,759.61	2.24
182	600115	东方航空	1,569,600.00	2.23
183	002439	启明星辰	1,566,853.00	2.22
184	601128	常熟银行	1,563,913.10	2.22
185	600037	歌华有线	1,560,028.00	2.21
186	000821	京山轻机	1,541,036.00	2.18
187	300009	安科生物	1,537,285.00	2.18
188	603985	恒润股份	1,532,748.20	2.17
189	002716	金贵银业	1,524,646.30	2.16
190	300377	赢时胜	1,522,000.00	2.16
191	002548	金新农	1,515,564.00	2.15
192	002341	新纶科技	1,510,900.00	2.14
193	300038	数知科技	1,492,493.00	2.12
194	300661	圣邦股份	1,479,633.00	2.10
195	000661	长春高新	1,470,468.00	2.08
196	603259	药明康德	1,463,334.12	2.07
197	300601	康泰生物	1,456,497.00	2.06
198	000418	小天鹅 A	1,453,535.00	2.06
199	600489	中金黄金	1,448,642.00	2.05
200	601212	白银有色	1,442,965.00	2.05
201	601137	博威合金	1,418,821.00	2.01
202	600837	海通证券	1,413,000.00	2.00

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	788,374,709.67
卖出股票的收入（成交）总额	811,814,880.76

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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

本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

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**

本基金合同尚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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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收到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	153,659.60
2	应收证券清算款	1,390,476.01
3	应收股利	-
4	应收利息	1,144.87
5	应收申购款	13,467.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,558,748.30

7.12.4 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。

7.12.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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
1,970	32,694.38	17,881,863.91	27.76%	46,526,055.55	72.24%

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	88,339.57	0.14%

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（2017年3月2日）基金份额总额	432,690,734.09
本报告期期初基金份额总额	88,558,783.60
本报告期基金总申购份额	40,084,247.50
减：本报告期基金总赎回份额	64,235,111.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	64,407,919.46

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	524,480,082.94	32.80%	383,553.42	31.42%	-
恒泰证券	2	420,834,963.90	26.32%	307,757.87	25.21%	-
太平洋证券	2	165,511,057.72	10.35%	121,037.87	9.91%	-
中信建投证券	1	137,894,287.39	8.62%	100,841.58	8.26%	-
国信证券	1	92,559,727.11	5.79%	86,200.33	7.06%	-
国金证券	1	68,580,658.58	4.29%	63,869.03	5.23%	-
安信证券	1	55,394,258.07	3.46%	40,509.86	3.32%	-
银河证券	1	44,461,920.69	2.78%	41,407.69	3.39%	-
渤海证券	1	43,693,582.21	2.73%	40,692.27	3.33%	-
广发证券	1	37,331,837.75	2.33%	27,301.00	2.24%	-
申银万国	1	8,310,946.80	0.52%	7,739.78	0.63%	-

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济商的排名。

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 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
机构	1	20190613-20190630	0.00	13,801,044.33	0.00	13,801,044.33	21.43%
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。

新华基金管理股份有限公司

二〇一九年八月二十四日