

**新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金**  
**2019 年年度报告**  
**2019 年 12 月 31 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：二〇二〇年三月二十六日

## §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 2020 年 3 月 25 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	15
6.1 审计意见.....	16
6.2 形成审计意见的基础.....	16
6.3 其他信息.....	16
6.4 管理层对财务报表的责任.....	16
6.5 注册会计师的责任.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3 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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	63
8.6	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 .....	63
8.7	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 .....	63
8.8	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 .....	63
8.9	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 .....	63
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	63
8.12	本报告期投资基金情况 .....	64
8.13	投资组合报告附注 .....	64
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>65</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	65
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
9.4	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 .....	65
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>66</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>66</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	66
11.2	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 .....	66
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
11.4	基金投资策略的改变 .....	66
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	66
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	67
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.9	其他重大事件 .....	69
<b>12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>71</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>71</b>
13.1	备查文件目录 .....	71
13.2	存放地点 .....	72
13.3	查阅方式 .....	72

## §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
场内简称	MSCI 新华
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	121,092,640.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 12 月 7 日

## 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	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 融资及转融通证券出借
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 负责人	姓名	齐岩	贺倩
	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 11 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2019 年	2018 年 11 月 7 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	7,248,848.24	-3,617,444.79
本期利润	22,110,893.88	-10,819,788.28
加权平均基金份额本期利润	0.3358	-0.0493
本期加权平均净值利润率	28.29%	-4.98%
本期基金份额净值增长率	38.80%	-6.41%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	30,352,216.77	-7,383,016.87
期末可供分配基金份额利润	0.2507	-0.0641
期末基金资产净值	157,298,957.83	107,709,623.13
期末基金份额净值	1.2990	0.9359
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	29.90%	-6.41%

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。

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

过去三个月	7.92%	0.72%	7.48%	0.73%	0.44%	-0.01%
过去六个月	8.30%	0.84%	7.60%	0.85%	0.70%	-0.01%
过去一年	38.80%	1.21%	34.59%	1.23%	4.21%	-0.02%
基金成立至今	29.90%	1.15%	26.71%	1.22%	3.19%	-0.07%

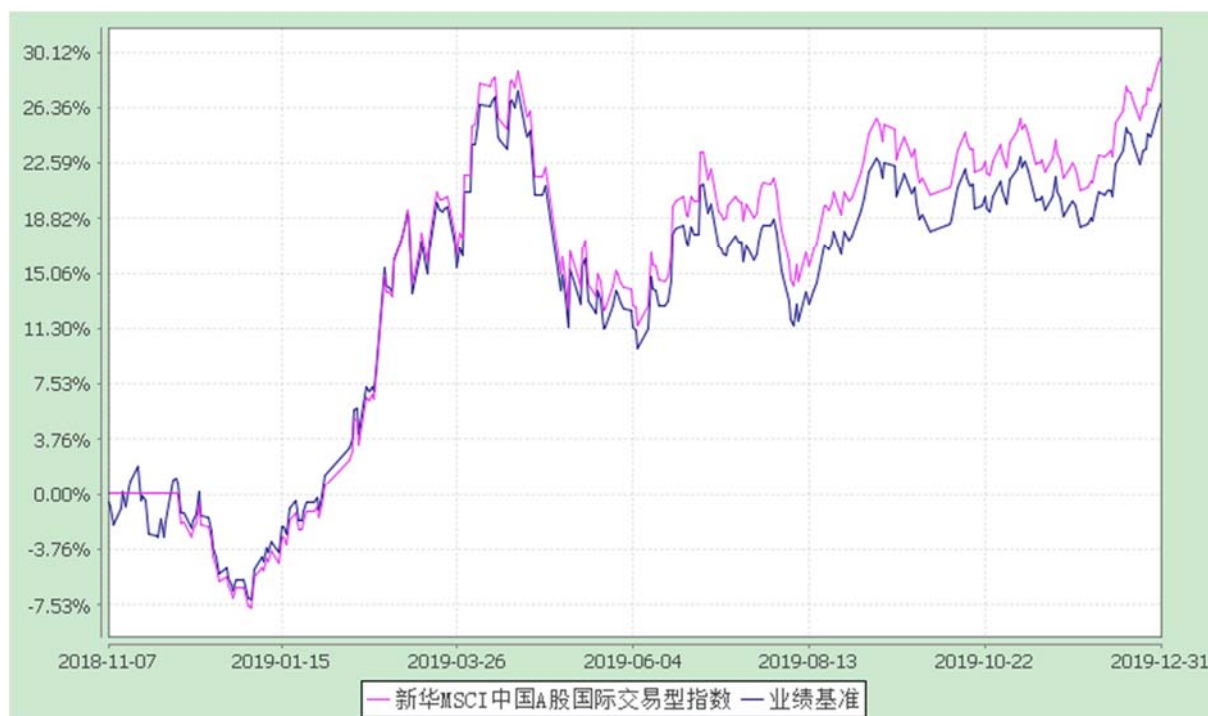
注：1、本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 3.2.2 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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2018 年 11 月 7 日至 2019 年 12 月 31 日)

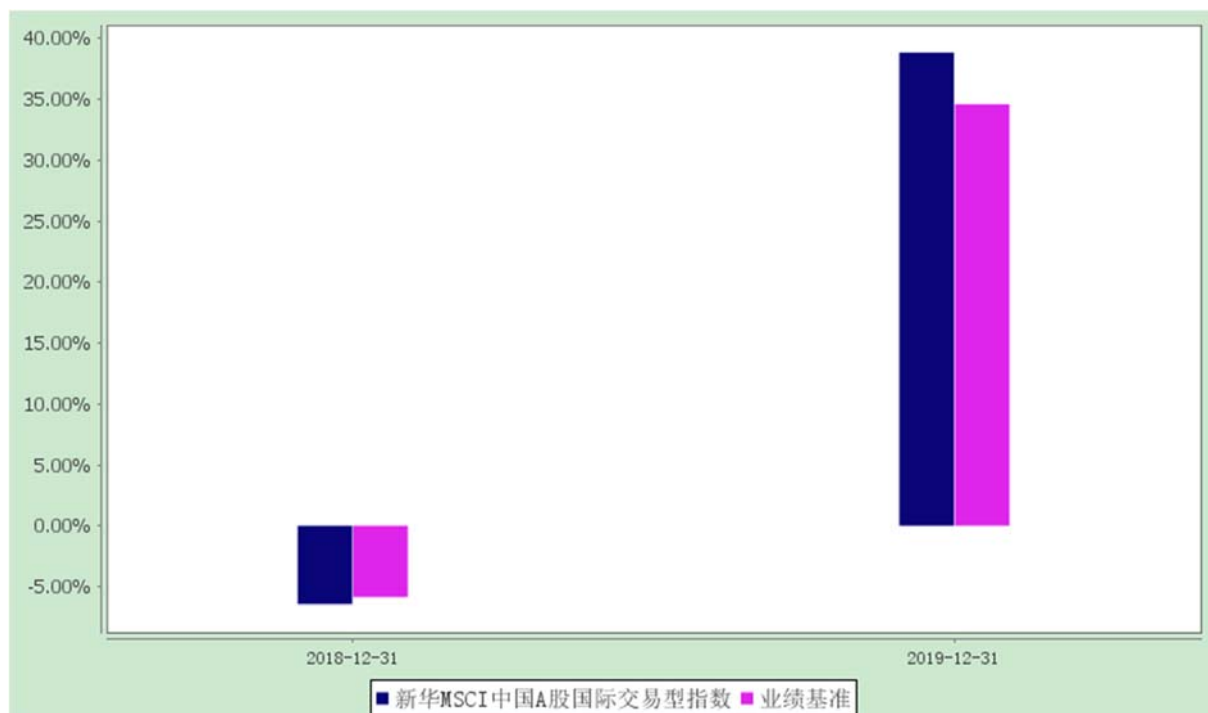


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





注：本报告期末本基金各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金无利润分配。

## §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 12 月 31 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、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金。

#### 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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、新华沪深 300 指数增强型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	2019-06-1	2019-08-06	4	工学硕士，历任南方基金交易算

	理助理。	9			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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易指导意见》（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 公平交易制度的执行情况

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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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，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 4 次季度成分股调整，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

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.2990 元，本报告期份额净值增长率为 38.80%，同期比较基准的增长率为 34.59%。

#### 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定的要求，完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

二、督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理

理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

三、根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

四、在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部对公司员工进行了法律法规的专项培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

通过上述工作，在本报告期内，公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

###### 4.7.1.1 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、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。

###### 4.7.1.2 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。

#### 4.7.1.3 投资管理部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询；
- 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。

#### 4.7.1.4 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。

#### 4.7.1.5 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部问询；
- 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未进行利润分配。

#### 4.9 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的情形。

### §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 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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《公开募集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,未发现有关损害基金持有人利益的行为。

### §6 审计报告

瑞华审字【2020】36010029 号

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了新华 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“MSCI 基金”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表、2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

## 6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了 MSCI 基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于 MSCI 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

MSCI 基金的管理人新华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括 MSCI 基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估 MSCI 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算 MSCI 基金、终止运



营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督 MSCI 基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误所导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计的过程中，我们运用了职业判断，并保持了职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发

现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对 MSCI 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致 MSCI 基金不能持续经营。

（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

吕金保 姜明明

北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 11 层

2020 年 3 月 25 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	5,511,981.58	2,590,698.81
结算备付金		158,599.92	324.92
存出保证金		30,388.72	8.99
交易性金融资产	7.4.7.2	154,841,550.73	105,571,558.71
其中：股票投资		154,841,550.73	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		35,070.32	-
应收利息	7.4.7.5	905.23	529.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>160,578,496.50</b>	<b>108,163,120.94</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 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		2,647,118.26	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		77,819.19	69,370.32
应付托管费		15,563.81	13,874.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	38,993.71	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	7.4.7.8	500,043.70	156,542.44
<b>负债合计</b>		<b>3,279,538.67</b>	<b>453,497.81</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	121,092,640.00	115,092,640.00
未分配利润	7.4.7.10	36,206,317.83	-7,383,016.87
<b>所有者权益合计</b>		<b>157,298,957.83</b>	<b>107,709,623.13</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>160,578,496.50</b>	<b>108,163,120.94</b>

注：报告截止 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2990 元，基金份额总额 121,092,640.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 11 月 7 日（基 金合同生效日）至 2018

			年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>23,172,079.98</b>	<b>-10,262,908.59</b>
1.利息收入		17,135.91	473,789.12
其中：存款利息收入	7.4.7.11	17,135.91	473,789.12
债券利息收入	7.4.7.14	-	-
资产支持证券利息收入	7.4.7.14.2	-	-
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）		8,004,737.81	-3,557,908.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,635,119.34	-3,590,389.40
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	7.4.7.17	369,618.47	32,481.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	14,862,045.64	-7,202,343.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	288,160.62	23,553.88
<b>减：二、费用</b>		<b>1,061,186.10</b>	<b>556,879.69</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	401,545.57	157,672.73
2. 托管费	7.4.10.2.2	80,309.15	31,534.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	234,397.86	291,532.23
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	7.4.7.21	344,933.52	76,140.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填</b>		<b>22,110,893.88</b>	<b>-10,819,788.28</b>

列)			
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>22,110,893.88</b>	<b>-10,819,788.28</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	-	22,110,893.88	22,110,893.88
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）	6,000,000.00	21,478,440.82	27,478,440.82
其中：1.基金申购款	204,000,000.00	47,090,321.91	251,090,321.91
2.基金赎回款	-198,000,000.00	-25,611,881.09	-223,611,881.09
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）	121,092,640.00	36,206,317.83	157,298,957.83
项目	上年度可比期间		
	2018 年 11 月 7 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 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）	280,092,640.00	-	280,092,640.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,819,788.28	-10,819,788.28
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）	-165,000,000.00	3,436,771.41	-161,563,228.59
其中：1.基金申购款	3,000,000.00	-87,335.74	2,912,664.26
2.基金赎回款	-168,000,000.00	3,524,107.15	-164,475,892.85
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）	115,092,640.00	-7,383,016.87	107,709,623.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张宗友，主管会计工作负责人：刘全胜，会计机构负责人：徐端骞

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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，存续期不特定。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 2020 年 03 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。此外，本基金财务报表在所有重大方面符合中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》中有关财务报表及其附注的披露要求。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 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，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，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。贷款及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，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相

关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(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的，基金管理人可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方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 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/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

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。

#### (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。

### 7.4.4.10 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，按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

(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。

### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内未有其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日

活期存款	5,511,981.58	2,590,698.81
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	5,511,981.58	2,590,698.81

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	147,181,848.58	154,841,550.73	7,659,702.15
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	147,181,848.58	154,841,550.73	7,659,702.15
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	112,773,902.20	105,571,558.71	-7,202,343.49
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		112,773,902.20	105,571,558.71	-7,202,343.49

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	820.13	529.41
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	85.10	0.10
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	905.23	529.51

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	38,993.71	213,711.01
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	38,993.71	213,711.01

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
其他应付款	-	-
预提费用	200,000.00	57,260.26
应付替代款	273,902.71	83,643.44
指数许可使用费	26,140.99	15,638.74
合计	500,043.70	156,542.44

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	204,000,000.00	204,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-198,000,000.00	-198,000,000.00
本期末	121,092,640.00	121,092,640.00

## 7.4.7.10 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	7,248,848.24	14,862,045.64	22,110,893.88
本期基金份额交易产生的变动数	25,449,499.24	-3,971,058.42	21,478,440.82
其中：基金申购款	45,759,484.13	1,330,837.78	47,090,321.91
基金赎回款	-20,309,984.89	-5,301,896.20	-25,611,881.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,352,216.77	5,854,101.06	36,206,317.83

## 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 7 日（基金合同 生效日）至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	9,808.96	148,788.75
定期存款利息收入	-	325,000.01
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	7,326.95	0.36
其他	-	-
合计	17,135.91	473,789.12

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息收入。

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 7 日（基金合 同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,998,127.41	-1,252,531.89
股票投资收益——赎回差价收入	2,636,991.93	-2,337,857.51
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	7,635,119.34	-3,590,389.40

## 7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 7 日（基金合 同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	115,583,365.50	48,646,227.52
减：卖出股票成本总额	110,585,238.09	49,898,759.41
买卖股票差价收入	4,998,127.41	-1,252,531.89

## 7.4.7.12.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 7 日（基金合 同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	223,611,881.09	164,475,892.85
减：现金支付赎回款总额	68,697,639.09	47,216,822.85
减：赎回股票成本总额	152,277,250.07	119,596,927.51
赎回差价收入	2,636,991.93	-2,337,857.51

## 7.4.7.13 基金投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无基金投资收益。

## 7.4.7.14 债券投资收益

## 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益。

**7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益**

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**7.4.7.16 衍生工具收益**

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年11月7日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	369,618.47	32,481.30
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	369,618.47	32,481.30

**7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2018年11月7日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
1.交易性金融资产	14,862,045.64	-7,202,343.49
——股票投资	14,862,045.64	-7,202,343.49
——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	14,862,045.64	-7,202,343.49

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年11月7日（基金合同生效日）至 2018年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	288,160.62	23,553.88
合计	288,160.62	23,553.88

注：替代损益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。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年11月7日（基金合同生效日） 至2018年12月31日
交易所市场交易费用	234,397.86	291,532.23
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	234,397.86	291,532.23

##### 7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间未持有基金投资。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年11月7日（基金合同生效日） 至2018年12月31日
审计费用	80,000.00	-
信息披露费	120,000.00	57,260.26
汇划手续费	5,508.34	2,841.21
指数使用费	44,425.18	15,638.74
上市费	95,000.00	-
其他	-	400.00
合计	344,933.52	76,140.21

注：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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

2020 年 03 月 16 日本基金增加扩位证券简称“MSCIETF 新华”。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
北京新华富时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2018年11月7日（基金合同生效日） 至2018年12月31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	429,136.49	0.18%	-	-

注：上年度可比期间无通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.5 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12月31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	338.85	0.38%	65.70	0.17%
关联方名称	上年度可比期间 2018年11月7日（基金合同生效日）至2018年12月31日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
-	-	-	-	-

注：上年度可比期间无通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年11月7日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	401,545.57	157,672.73
其中：支付销售机构的客户维护费	8,279.93	0.00

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、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年11月7日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	80,309.15	31,534.52

注：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)。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上期可比期间未发生关联方销售服务费。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 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,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

#### 7.4.10.4.2 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

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

### 7.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年11月7日(基金合同生效日) 至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	5,511,981.58	9,808.96	2,590,698.81	148,788.75

注: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。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

#### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

2019年12月31日,本基金持有382,500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1,338,505.54元,估值总额为人民币1,411,425.00元,占基金资产净值的比例为0.90%。

#### 7.4.10.7.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间未持有本基金管理人以及管理人关联方所管理基金。

### 7.4.11 利润分配情况

报告截至2019年12月31日止无收益分配事项。



7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-01-06	网下中签	43.98	43.98	2,631.00	115,711.38	115,711.38	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	网下中签	28.21	28.21	3,153.00	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	网下中签	5.74	5.74	1,146.00	6,578.04	6,578.04	-
002466	天齐锂业	2019-12-26	2020-01-03	战略配售	8.75	30.18	2,310.00	20,212.50	69,715.80	-
601916	浙商银行	2019-11-18	2020-05-26	战略配售锁定	4.94	4.66	294,195.00	1,453,323.30	1,370,948.70	-
688366	昊海生科	2019-10-23	2020-04-30	战略配售锁定	89.23	79.78	2,711.00	241,902.53	216,283.58	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019-12-30	并购重组	39.39	2020-01-02	40.43	5,668.00	152,742.87	223,262.52	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。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；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

###### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

###### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

##### 7.4.13.3 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。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。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。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	5,511,981.58	-	-	-	5,511,981.58
结算备付金	158,599.92	-	-	-	158,599.92
存出保证金	30,388.72	-	-	-	30,388.72
交易性金融资产	-	-	-	154,841,550.73	154,841,550.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	35,070.32	35,070.32

应收利息	-	-	-	905.23	905.23
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,700,970.22	-	-	154,877,526.28	160,578,496.50
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	-	-	-	2,647,118.26	2,647,118.26
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	77,819.19	77,819.19
应付托管费	-	-	-	15,563.81	15,563.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	38,993.71	38,993.71
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	500,043.70	500,043.70
负债总计	-	-	-	3,279,538.67	3,279,538.67
利率敏感度缺口	5,700,970.22	-	-	151,597,987.61	157,298,957.83
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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金无债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 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	154,841,550.73	98.44	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	-	-	-	-
合计	154,841,550.73	98.44	105,571,558.71	98.01

##### 7.4.13.4.3.2 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%或下降 1%		
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：人民币元）	
		本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	增加约 1,540,442.44	增加约 1,540,442.44
	沪深 300 指数下降 1%	减少约 1,540,442.44	减少约 1,540,442.44

## §8 投资组合报告

## 8.1 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	154,841,550.73	96.43
	其中：股票	154,841,550.73	96.43
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	5,670,581.50	3.53
8	其他各项资产	66,364.27	0.04
9	合计	160,578,496.50	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项中不含可退替代款估值增值。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 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	2,024,771.00	1.29
B	采矿业	4,647,796.12	2.95
C	制造业	71,612,614.10	45.53

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,340,277.12	2.76
E	建筑业	3,749,162.00	2.38
F	批发和零售业	2,681,845.40	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	4,526,126.00	2.88
H	住宿和餐饮业	201,282.30	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,878,946.17	4.37
J	金融业	39,284,515.90	24.97
K	房地产业	7,139,736.00	4.54
L	租赁和商务服务业	1,845,821.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	961,905.00	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	190,134.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,446,542.74	0.92
R	文化、体育和娱乐业	1,259,509.80	0.80
S	综合	230,566.00	0.15
	合计	153,021,550.65	97.28

## 8.2.2 积极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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	442,473.34	0.28
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,370,948.70	0.87
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	6,578.04	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,820,000.08	1.16

### 8.2.3 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投资股票。

## 8.3 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

### 8.3.1 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

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	6,500	7,689,500.00	4.89
2	601318	中国平安	55,600	4,751,576.00	3.02
3	600036	招商银行	105,900	3,979,722.00	2.53
4	000858	五粮液	19,900	2,646,899.00	1.68
5	601166	兴业银行	106,700	2,112,660.00	1.34
6	600900	长江电力	113,023	2,077,362.74	1.32
7	600276	恒瑞医药	22,680	1,984,953.60	1.26
8	600000	浦发银行	150,730	1,864,530.10	1.19
9	601398	工商银行	276,900	1,628,172.00	1.04
10	000002	万科A	49,900	1,605,782.00	1.02

11	002415	海康威视	48,037	1,572,731.38	1.00
12	000001	平安银行	88,200	1,450,890.00	0.92
13	601288	农业银行	382,500	1,411,425.00	0.90
14	600030	中信证券	50,500	1,277,650.00	0.81
15	603288	海天味业	11,600	1,247,116.00	0.79
16	601601	中国太保	32,300	1,222,232.00	0.78
17	601668	中国建筑	215,600	1,211,672.00	0.77
18	300750	宁德时代	11,300	1,202,320.00	0.76
19	600016	民生银行	182,100	1,149,051.00	0.73
20	601328	交通银行	201,600	1,135,008.00	0.72
21	600585	海螺水泥	20,500	1,123,400.00	0.71
22	000333	美的集团	17,800	1,036,850.00	0.66
23	000651	格力电器	15,400	1,009,932.00	0.64
24	002475	立讯精密	27,450	1,001,925.00	0.64
25	600048	保利地产	61,100	988,598.00	0.63
26	600887	伊利股份	31,300	968,422.00	0.62
27	600104	上汽集团	40,000	954,000.00	0.61
28	600050	中国联通	159,400	938,866.00	0.60
29	300498	温氏股份	27,300	917,280.00	0.58
30	600309	万华化学	16,100	904,337.00	0.57
31	601818	光大银行	204,400	901,404.00	0.57
32	601766	中国中车	124,900	891,786.00	0.57
33	601888	中国国旅	10,000	889,500.00	0.57
34	002304	洋河股份	7,700	850,850.00	0.54
35	002142	宁波银行	28,900	813,535.00	0.52
36	001979	招商蛇口	40,600	806,722.00	0.51
37	002714	牧原股份	8,900	790,231.00	0.50
38	000725	京东方 A	173,900	789,506.00	0.50
39	601688	华泰证券	37,800	767,718.00	0.49
40	600031	三一重工	43,000	733,150.00	0.47
41	601211	国泰君安	38,600	713,714.00	0.45
42	601229	上海银行	73,010	692,864.90	0.44
43	603259	药明康德	7,500	690,900.00	0.44
44	600028	中国石化	130,900	668,899.00	0.43
45	601988	中国银行	180,400	665,676.00	0.42
46	000568	泸州老窖	7,500	650,100.00	0.41
47	600837	海通证券	41,600	643,136.00	0.41
48	300015	爱尔眼科	15,909	629,360.04	0.40
49	601006	大秦铁路	76,300	626,423.00	0.40
50	000063	中兴通讯	17,700	626,403.00	0.40
51	601169	北京银行	108,600	616,848.00	0.39
52	601989	中国重工	117,500	615,700.00	0.39
53	600690	海尔智家	31,300	610,350.00	0.39
54	601186	中国铁建	59,100	599,274.00	0.38

55	000166	申万宏源	115,700	592,384.00	0.38
56	000538	云南白药	6,600	590,238.00	0.38
57	601390	中国中铁	95,700	568,458.00	0.36
58	600019	宝钢股份	95,300	547,022.00	0.35
59	300059	东方财富	34,500	544,065.00	0.35
60	600999	招商证券	29,400	537,726.00	0.34
61	600745	闻泰科技	5,800	536,500.00	0.34
62	601336	新华保险	10,700	525,905.00	0.33
63	600015	华夏银行	65,800	504,686.00	0.32
64	600406	国电南瑞	23,716	502,304.88	0.32
65	601628	中国人寿	14,300	498,641.00	0.32
66	000338	潍柴动力	30,800	489,104.00	0.31
67	601857	中国石油	83,200	485,056.00	0.31
68	600346	恒力石化	30,120	484,329.60	0.31
69	002024	苏宁易购	47,800	483,258.00	0.31
70	002027	分众传媒	75,400	472,004.00	0.30
71	601899	紫金矿业	100,800	462,672.00	0.29
72	000776	广发证券	30,400	461,168.00	0.29
73	601012	隆基股份	18,570	461,093.10	0.29
74	601155	新城控股	11,600	449,152.00	0.29
75	002594	比亚迪	9,300	443,331.00	0.28
76	600340	华夏幸福	15,400	441,980.00	0.28
77	600547	山东黄金	13,361	435,835.82	0.28
78	000876	新希望	21,700	432,915.00	0.28
79	601066	中信建投	14,200	431,680.00	0.27
80	603501	韦尔股份	3,000	430,200.00	0.27
81	600919	江苏银行	59,300	429,332.00	0.27
82	600741	华域汽车	16,200	421,038.00	0.27
83	603160	汇顶科技	2,000	412,600.00	0.26
84	601088	中国神华	22,600	412,450.00	0.26
85	000895	双汇发展	14,100	409,323.00	0.26
86	600809	山西汾酒	4,500	403,650.00	0.26
87	000661	长春高新	900	402,300.00	0.26
88	603993	洛阳钼业	90,700	395,452.00	0.25
89	002230	科大讯飞	11,300	389,624.00	0.25
90	600009	上海机场	4,900	385,875.00	0.25
91	601225	陕西煤业	42,800	384,772.00	0.24
92	600703	三安光电	20,900	383,724.00	0.24
93	601009	南京银行	43,600	382,372.00	0.24
94	300760	迈瑞医疗	2,100	381,990.00	0.24
95	601138	工业富联	20,400	372,708.00	0.24
96	601933	永辉超市	49,100	370,214.00	0.24
97	601901	方正证券	42,300	366,741.00	0.23
98	600588	用友网络	12,790	363,236.00	0.23

99	601939	建设银行	49,300	356,439.00	0.23
100	600436	片仔癀	3,100	340,597.00	0.22
101	300122	智飞生物	6,800	337,688.00	0.21
102	600383	金地集团	23,200	336,400.00	0.21
103	601985	中国核电	66,600	333,000.00	0.21
104	002241	歌尔股份	16,700	332,664.00	0.21
105	600958	东方证券	30,600	329,256.00	0.21
106	000069	华侨城 A	42,100	327,959.00	0.21
107	603986	兆易创新	1,600	327,824.00	0.21
108	600570	恒生电子	4,120	320,247.60	0.20
109	600886	国投电力	34,800	319,464.00	0.20
110	002600	领益智造	29,300	317,905.00	0.20
111	600029	南方航空	44,100	316,638.00	0.20
112	000100	TCL 集团	69,600	311,112.00	0.20
113	600010	包钢股份	234,100	309,012.00	0.20
114	002352	顺丰控股	8,300	308,677.00	0.20
115	002236	大华股份	15,411	306,370.68	0.19
116	300033	同花顺	2,800	305,508.00	0.19
117	300003	乐普医疗	9,100	301,028.00	0.19
118	002466	天齐锂业	9,910	299,083.80	0.19
119	601877	正泰电器	11,000	294,800.00	0.19
120	002555	三七互娱	10,830	291,651.90	0.19
121	002311	海大集团	8,100	291,600.00	0.19
122	002624	完美世界	6,600	291,324.00	0.19
123	600606	绿地控股	41,700	289,815.00	0.18
124	300601	康泰生物	3,300	289,707.00	0.18
125	002044	美年健康	19,280	287,079.20	0.18
126	601669	中国电建	65,500	284,270.00	0.18
127	600115	东方航空	47,800	277,718.00	0.18
128	000938	紫光股份	8,716	275,425.60	0.18
129	600061	国投资本	18,100	274,034.00	0.17
130	600196	复星医药	10,300	273,980.00	0.17
131	000596	古井贡酒	2,000	271,840.00	0.17
132	002493	荣盛石化	21,500	266,385.00	0.17
133	300413	芒果超媒	7,580	264,996.80	0.17
134	002736	国信证券	21,100	264,805.00	0.17
135	601788	光大证券	20,100	263,310.00	0.17
136	600438	通威股份	19,900	261,287.00	0.17
137	300124	汇川技术	8,500	260,440.00	0.17
138	601872	招商轮船	31,200	257,712.00	0.16
139	600332	白云山	7,200	256,392.00	0.16
140	300142	沃森生物	7,900	256,276.00	0.16
141	601618	中国中冶	91,400	255,920.00	0.16
142	002001	新 和 成	11,000	255,860.00	0.16

143	002007	华兰生物	7,200	253,080.00	0.16
144	002120	韵达股份	7,600	253,080.00	0.16
145	600893	航发动力	11,600	251,488.00	0.16
146	600018	上港集团	43,500	250,995.00	0.16
147	300014	亿纬锂能	5,000	250,800.00	0.16
148	002916	深南电路	1,740	247,254.00	0.16
149	600660	福耀玻璃	10,300	247,097.00	0.16
150	002050	三花智控	14,220	246,432.60	0.16
151	600183	生益科技	11,700	244,764.00	0.16
152	601377	兴业证券	34,400	243,552.00	0.15
153	300347	泰格医药	3,850	243,127.50	0.15
154	600352	浙江龙盛	16,700	241,649.00	0.15
155	600926	杭州银行	26,300	240,908.00	0.15
156	601600	中国铝业	67,200	237,888.00	0.15
157	600795	国电电力	100,900	236,106.00	0.15
158	000066	中国长城	15,000	233,400.00	0.15
159	000768	中航飞机	14,200	232,596.00	0.15
160	300433	蓝思科技	16,800	232,176.00	0.15
161	300144	宋城演艺	7,500	231,825.00	0.15
162	603899	晨光文具	4,700	229,078.00	0.15
163	300136	信维通信	5,000	226,900.00	0.14
164	601100	恒立液压	4,500	223,875.00	0.14
165	600705	中航资本	46,100	223,585.00	0.14
166	603799	华友钴业	5,668	223,262.52	0.14
167	600674	川投能源	22,600	222,610.00	0.14
168	600271	航天信息	9,600	222,432.00	0.14
169	000786	北新建材	8,700	221,415.00	0.14
170	000157	中联重科	33,000	220,440.00	0.14
171	002371	北方华创	2,500	220,000.00	0.14
172	000425	徐工机械	40,100	219,347.00	0.14
173	002146	荣盛发展	22,300	219,209.00	0.14
174	000963	华东医药	8,980	218,932.40	0.14
175	601990	南京证券	16,900	218,179.00	0.14
176	002456	欧菲光	13,900	216,840.00	0.14
177	002032	苏泊尔	2,800	214,984.00	0.14
178	002202	金风科技	17,761	212,243.95	0.13
179	000656	金科股份	27,400	210,432.00	0.13
180	603369	今世缘	6,400	209,408.00	0.13
181	002179	中航光电	5,350	208,971.00	0.13
182	601108	财通证券	18,400	208,656.00	0.13
183	601727	上海电气	41,700	207,666.00	0.13
184	601021	春秋航空	4,700	206,283.00	0.13
185	002157	正邦科技	12,600	204,120.00	0.13
186	000703	恒逸石化	14,600	203,232.00	0.13

187	000783	长江证券	28,400	202,776.00	0.13
188	600111	北方稀土	18,700	202,708.00	0.13
189	002271	东方雨虹	7,700	202,587.00	0.13
190	300450	先导智能	4,500	202,230.00	0.13
191	000961	中南建设	19,100	201,505.00	0.13
192	000860	顺鑫农业	3,820	201,237.60	0.13
193	000625	长安汽车	20,000	200,600.00	0.13
194	300408	三环集团	9,000	200,520.00	0.13
195	601658	邮储银行	34,100	199,826.00	0.13
196	000723	美锦能源	21,100	198,973.00	0.13
197	000977	浪潮信息	6,600	198,660.00	0.13
198	601111	中国国航	20,500	198,645.00	0.13
199	002463	沪电股份	8,900	197,669.00	0.13
200	600085	同仁堂	7,000	197,260.00	0.13
201	002410	广联达	5,800	197,084.00	0.13
202	600176	中国巨石	17,962	195,785.80	0.12
203	002460	赣锋锂业	5,600	195,048.00	0.12
204	300454	深信服	1,700	194,463.00	0.12
205	002739	万达电影	10,700	194,205.00	0.12
206	002384	东山精密	8,300	192,145.00	0.12
207	300628	亿联网络	2,600	188,266.00	0.12
208	601198	东兴证券	14,200	186,588.00	0.12
209	600801	华新水泥	7,040	186,067.20	0.12
210	600004	白云机场	10,600	184,970.00	0.12
211	600023	浙能电力	46,600	184,536.00	0.12
212	600600	青岛啤酒	3,600	183,600.00	0.12
213	601607	上海医药	9,900	181,863.00	0.12
214	600362	江西铜业	10,700	181,151.00	0.12
215	002353	杰瑞股份	4,900	181,104.00	0.12
216	002180	纳思达	5,500	181,060.00	0.12
217	600584	长电科技	8,200	180,236.00	0.11
218	601998	中信银行	29,200	180,164.00	0.11
219	600177	雅戈尔	25,780	179,686.60	0.11
220	002153	石基信息	4,600	179,400.00	0.11
221	600536	中国软件	2,500	179,225.00	0.11
222	000627	天茂集团	25,400	178,816.00	0.11
223	300251	光线传媒	15,100	178,180.00	0.11
224	000671	阳光城	20,800	176,800.00	0.11
225	002673	西部证券	18,000	176,400.00	0.11
226	601919	中远海控	33,200	174,964.00	0.11
227	600482	中国动力	8,700	174,000.00	0.11
228	002422	科伦药业	7,400	173,826.00	0.11
229	002812	恩捷股份	3,440	173,720.00	0.11
230	601018	宁波港	45,100	171,380.00	0.11

231	000050	深天马 A	10,500	171,045.00	0.11
232	603589	口子窖	3,100	170,221.00	0.11
233	600516	方大炭素	13,939	169,498.24	0.11
234	002129	中环股份	14,300	168,883.00	0.11
235	601838	成都银行	18,600	168,702.00	0.11
236	600583	海油工程	22,700	167,526.00	0.11
237	600426	华鲁恒升	8,400	166,908.00	0.11
238	600208	新湖中宝	44,100	166,698.00	0.11
239	002508	老板电器	4,900	165,669.00	0.11
240	002065	东华软件	16,000	165,120.00	0.10
241	600637	东方明珠	17,600	164,736.00	0.10
242	600498	烽火通信	6,000	164,700.00	0.10
243	300782	卓胜微	400	164,148.00	0.10
244	600763	通策医疗	1,600	164,048.00	0.10
245	603833	欧派家居	1,400	163,800.00	0.10
246	601117	中国化学	25,400	163,576.00	0.10
247	002405	四维图新	10,100	162,610.00	0.10
248	600066	宇通客车	11,400	162,450.00	0.10
249	601360	三六零	6,900	162,219.00	0.10
250	600170	上海建工	45,700	161,778.00	0.10
251	300308	中际旭创	3,100	161,665.00	0.10
252	600872	中炬高新	4,100	161,335.00	0.10
253	000728	国元证券	17,400	161,298.00	0.10
254	603019	中科曙光	4,660	161,142.80	0.10
255	002601	龙蟠佰利	10,400	160,056.00	0.10
256	000999	华润三九	5,047	159,888.96	0.10
257	600487	亨通光电	9,800	159,348.00	0.10
258	601878	浙商证券	14,300	159,159.00	0.10
259	601992	金隅集团	42,600	158,898.00	0.10
260	300383	光环新网	7,900	158,553.00	0.10
261	601997	贵阳银行	16,560	158,313.60	0.10
262	600673	东阳光	15,400	157,696.00	0.10
263	002049	紫光国微	3,100	157,604.00	0.10
264	600068	葛洲坝	23,500	156,980.00	0.10
265	603156	养元饮品	5,400	156,762.00	0.10
266	002439	启明星辰	4,600	155,480.00	0.10
267	002821	凯莱英	1,200	155,400.00	0.10
268	600150	中国船舶	7,100	154,496.00	0.10
269	002506	协鑫集成	26,100	154,251.00	0.10
270	300207	欣旺达	7,900	154,208.00	0.10
271	601555	东吴证券	15,300	152,847.00	0.10
272	600760	中航沈飞	4,800	151,680.00	0.10
273	600161	天坛生物	5,400	150,876.00	0.10
274	300529	健帆生物	2,100	150,864.00	0.10

275	600369	西南证券	29,000	150,510.00	0.10
276	600489	中金黄金	17,700	150,096.00	0.10
277	002797	第一创业	18,000	149,040.00	0.09
278	002926	华西证券	13,500	148,635.00	0.09
279	600642	申能股份	25,300	146,993.00	0.09
280	600221	海航控股	84,400	146,012.00	0.09
281	300676	华大基因	2,100	144,270.00	0.09
282	600109	国金证券	15,400	143,220.00	0.09
283	600038	中直股份	3,000	143,130.00	0.09
284	601238	广汽集团	12,220	142,851.80	0.09
285	601233	桐昆股份	9,500	142,405.00	0.09
286	601231	环旭电子	7,400	142,302.00	0.09
287	601966	玲珑轮胎	6,200	142,166.00	0.09
288	600845	宝信软件	4,320	142,128.00	0.09
289	002773	康弘药业	3,790	140,116.30	0.09
290	000709	河钢股份	54,300	140,094.00	0.09
291	603517	绝味食品	3,000	139,350.00	0.09
292	603939	益丰药房	1,900	139,118.00	0.09
293	000975	银泰黄金	10,200	138,822.00	0.09
294	300558	贝达药业	2,100	137,970.00	0.09
295	600219	南山铝业	61,400	137,536.00	0.09
296	002127	南极电商	12,600	137,466.00	0.09
297	002373	千方科技	7,600	137,104.00	0.09
298	002690	美亚光电	3,500	136,850.00	0.09
299	600297	广汇汽车	41,900	136,594.00	0.09
300	600704	物产中大	26,000	136,500.00	0.09
301	600011	华能国际	24,461	136,492.38	0.09
302	601216	君正集团	43,400	135,842.00	0.09
303	600998	九州通	9,600	135,840.00	0.09
304	600909	华安证券	18,600	135,780.00	0.09
305	603658	安图生物	1,400	134,932.00	0.09
306	600188	兖州煤业	12,700	134,112.00	0.09
307	600100	同方股份	15,200	133,304.00	0.08
308	601799	星宇股份	1,400	132,972.00	0.08
309	300146	汤臣倍健	8,100	131,949.00	0.08
310	601099	太平洋	34,800	131,892.00	0.08
311	002078	太阳纸业	13,400	131,856.00	0.08
312	600867	通化东宝	10,400	131,560.00	0.08
313	600153	建发股份	14,600	131,254.00	0.08
314	600522	中天科技	15,800	131,140.00	0.08
315	600528	中铁工业	11,400	131,100.00	0.08
316	600885	宏发股份	3,800	130,910.00	0.08
317	600118	中国卫星	6,100	130,357.00	0.08
318	600655	豫园股份	16,600	130,144.00	0.08



319	600132	重庆啤酒	2,500	129,900.00	0.08
320	600875	东方电气	14,100	129,579.00	0.08
321	600779	水井坊	2,500	129,375.00	0.08
322	601800	中国交建	14,100	129,156.00	0.08
323	600298	安琪酵母	4,200	128,814.00	0.08
324	603338	浙江鼎力	1,800	128,700.00	0.08
325	603707	健友股份	3,100	128,588.00	0.08
326	000629	攀钢钒钛	44,000	128,480.00	0.08
327	601128	常熟银行	14,100	128,451.00	0.08
328	002013	中航机电	18,500	128,390.00	0.08
329	600027	华电国际	34,900	128,083.00	0.08
330	002465	海格通信	11,800	127,794.00	0.08
331	002299	圣农发展	5,300	127,624.00	0.08
332	600089	特变电工	19,100	127,015.00	0.08
333	300012	华测检测	8,500	126,735.00	0.08
334	000630	铜陵有色	54,100	126,053.00	0.08
335	603885	吉祥航空	8,400	126,000.00	0.08
336	002558	巨人网络	6,959	125,679.54	0.08
337	600155	华创阳安	8,900	124,867.00	0.08
338	300253	卫宁健康	8,300	124,334.00	0.08
339	600816	安信信托	28,000	124,320.00	0.08
340	002411	延安必康	7,900	123,477.00	0.08
341	000402	金融街	15,200	123,424.00	0.08
342	300070	碧水源	16,200	123,120.00	0.08
343	603882	金域医学	2,400	122,928.00	0.08
344	300699	光威复材	2,700	122,850.00	0.08
345	600895	张江高科	8,000	122,480.00	0.08
346	600977	中国电影	8,000	121,760.00	0.08
347	600688	上海石化	31,362	121,370.94	0.08
348	000415	渤海租赁	31,800	120,840.00	0.08
349	002081	金螳螂	13,700	120,834.00	0.08
350	000031	大悦城	16,800	120,624.00	0.08
351	600739	辽宁成大	7,900	120,317.00	0.08
352	600535	天士力	7,800	120,276.00	0.08
353	000423	东阿阿胶	3,400	120,258.00	0.08
354	002500	山西证券	14,500	120,205.00	0.08
355	603858	步长制药	5,820	120,008.40	0.08
356	600699	均胜电子	6,700	119,930.00	0.08
357	000825	太钢不锈	29,300	119,837.00	0.08
358	600989	宝丰能源	12,600	119,826.00	0.08
359	603444	吉比特	400	119,396.00	0.08
360	300357	我武生物	2,700	119,205.00	0.08
361	002152	广电运通	12,400	119,164.00	0.08
362	300017	网宿科技	12,500	119,125.00	0.08

363	603866	桃李面包	2,800	118,832.00	0.08
364	002110	三钢闽光	12,650	118,404.00	0.08
365	000401	冀东水泥	6,900	117,369.00	0.07
366	600521	华海药业	6,800	117,368.00	0.07
367	002010	传化智联	16,800	117,264.00	0.07
368	600398	海澜之家	15,100	115,968.00	0.07
369	000750	国海证券	21,600	115,344.00	0.07
370	600256	广汇能源	34,700	114,857.00	0.07
371	600466	蓝光发展	15,500	114,235.00	0.07
372	600497	驰宏锌锗	25,900	113,442.00	0.07
373	603000	人民网	5,700	112,803.00	0.07
374	000686	东北证券	12,091	112,446.30	0.07
375	300024	机器人	8,000	112,000.00	0.07
376	300285	国瓷材料	4,900	111,965.00	0.07
377	002387	维信诺	7,000	111,300.00	0.07
378	002268	卫士通	4,300	110,897.00	0.07
379	601699	潞安环能	15,255	110,751.30	0.07
380	601958	金钼股份	13,800	110,538.00	0.07
381	601098	中南传媒	9,200	109,848.00	0.07
382	600486	扬农化工	1,600	109,808.00	0.07
383	002507	涪陵榨菜	4,100	109,593.00	0.07
384	600415	小商品城	28,100	108,747.00	0.07
385	600021	上海电力	13,500	108,675.00	0.07
386	600201	生物股份	5,800	108,576.00	0.07
387	000513	丽珠集团	3,190	107,503.00	0.07
388	002385	大北农	21,500	107,070.00	0.07
389	600372	中航电子	7,500	106,800.00	0.07
390	600511	国药股份	3,900	106,431.00	0.07
391	002372	伟星新材	8,060	106,150.20	0.07
392	600376	首开股份	13,300	106,001.00	0.07
393	002174	游族网络	4,542	105,692.34	0.07
394	000027	深圳能源	17,000	105,570.00	0.07
395	601866	中远海发	40,700	105,413.00	0.07
396	600315	上海家化	3,400	105,196.00	0.07
397	600733	北汽蓝谷	17,900	104,536.00	0.07
398	002281	光迅科技	3,500	104,230.00	0.07
399	002340	格林美	21,400	104,218.00	0.07
400	000932	华菱钢铁	21,720	103,821.60	0.07
401	600258	首旅酒店	5,030	103,668.30	0.07
402	600460	士兰微	6,700	103,649.00	0.07
403	002223	鱼跃医疗	5,100	103,632.00	0.07
404	002399	海普瑞	5,300	103,403.00	0.07
405	600380	健康元	9,980	103,293.00	0.07
406	002019	亿帆医药	6,335	102,943.75	0.07

407	600160	巨化股份	14,100	102,648.00	0.07
408	600959	江苏有线	25,700	102,286.00	0.07
409	601106	中国一重	35,100	102,141.00	0.06
410	600776	东方通信	4,900	102,067.00	0.06
411	600143	金发科技	14,000	101,920.00	0.06
412	000089	深圳机场	10,400	101,608.00	0.06
413	600566	济川药业	4,191	101,338.38	0.06
414	600968	海油发展	34,500	101,085.00	0.06
415	002414	高德红外	4,800	100,800.00	0.06
416	300296	利亚德	13,100	100,477.00	0.06
417	000998	隆平高科	6,800	100,028.00	0.06
418	300595	欧普康视	2,100	99,393.00	0.06
419	000983	西山煤电	16,200	99,306.00	0.06
420	000623	吉林敖东	6,000	99,180.00	0.06
421	002572	索菲亚	4,700	98,465.00	0.06
422	600754	锦江酒店	3,400	97,614.00	0.06
423	600675	中华企业	20,920	97,278.00	0.06
424	600820	隧道股份	16,100	97,244.00	0.06
425	600373	中文传媒	7,100	96,631.00	0.06
426	603883	老百姓	1,500	96,120.00	0.06
427	600008	首创股份	29,200	96,068.00	0.06
428	601179	中国西电	26,100	95,004.00	0.06
429	601598	中国外运	22,300	94,998.00	0.06
430	000413	东旭光电	28,200	94,752.00	0.06
431	002195	二三四五	29,310	94,671.30	0.06
432	600079	人福医药	7,000	94,570.00	0.06
433	000729	燕京啤酒	14,500	94,540.00	0.06
434	600549	厦门钨业	7,200	93,888.00	0.06
435	600808	马钢股份	30,300	93,021.00	0.06
436	000883	湖北能源	22,300	92,991.00	0.06
437	600967	内蒙一机	8,700	92,481.00	0.06
438	600737	中粮糖业	10,900	92,214.00	0.06
439	002563	森马服饰	9,300	91,791.00	0.06
440	000898	鞍钢股份	27,250	91,287.50	0.06
441	600446	金证股份	4,400	90,552.00	0.06
442	600026	中远海能	14,100	89,958.00	0.06
443	000960	锡业股份	8,600	89,784.00	0.06
444	002294	信立泰	4,500	89,730.00	0.06
445	600598	北大荒	9,200	89,608.00	0.06
446	002217	合力泰	16,100	89,355.00	0.06
447	601333	广深铁路	29,000	88,740.00	0.06
448	600567	山鹰纸业	23,500	88,595.00	0.06
449	000028	国药一致	1,900	86,184.00	0.05
450	000997	新大陆	5,400	85,752.00	0.05

451	000778	新兴铸管	20,500	85,485.00	0.05
452	002074	国轩高科	5,800	84,390.00	0.05
453	600782	新钢股份	16,400	84,132.00	0.05
454	600572	康恩贝	13,650	83,947.50	0.05
455	600879	航天电子	14,000	83,720.00	0.05
456	600273	嘉化能源	7,400	83,250.00	0.05
457	600392	盛和资源	9,100	82,537.00	0.05
458	600863	内蒙华电	29,800	81,950.00	0.05
459	000581	威孚高科	4,300	81,915.00	0.05
460	600339	中油工程	24,000	81,360.00	0.05
461	601880	大连港	39,900	80,997.00	0.05
462	000046	泛海控股	17,800	80,990.00	0.05
463	601168	西部矿业	12,200	80,764.00	0.05
464	600643	爱建集团	8,300	79,680.00	0.05
465	002583	海能达	9,400	79,054.00	0.05
466	601000	唐山港	30,400	79,040.00	0.05
467	000830	鲁西化工	7,500	78,825.00	0.05
468	000503	国新健康	4,600	78,752.00	0.05
469	000732	泰禾集团	12,800	78,720.00	0.05
470	002085	万丰奥威	11,200	78,400.00	0.05
471	600282	南钢股份	22,700	78,315.00	0.05
472	000060	中金岭南	18,100	77,830.00	0.05
473	000039	中集集团	7,860	77,185.20	0.05
474	000738	航发控制	5,900	77,113.00	0.05
475	002603	以岭药业	6,200	77,066.00	0.05
476	300072	三聚环保	12,000	75,840.00	0.05
477	000559	万向钱潮	14,100	75,717.00	0.05
478	002124	天邦股份	6,000	75,300.00	0.05
479	600649	城投控股	13,100	74,932.00	0.05
480	002092	中泰化学	10,900	74,011.00	0.05
481	601718	际华集团	22,600	73,676.00	0.05
482	600827	百联股份	8,200	73,636.00	0.05
483	600500	中化国际	13,867	73,495.10	0.05
484	600777	新潮能源	34,700	72,870.00	0.05
485	600718	东软集团	6,400	72,640.00	0.05
486	000839	中信国安	20,300	71,862.00	0.05
487	600056	中国医药	5,500	71,775.00	0.05
488	600873	梅花生物	16,000	71,200.00	0.05
489	600062	华润双鹤	5,400	70,470.00	0.04
490	000598	兴蓉环境	15,200	70,376.00	0.04
491	002038	双鹭药业	5,300	69,695.00	0.04
492	600648	外高桥	4,000	69,480.00	0.04
493	600260	凯乐科技	5,120	69,478.40	0.04
494	600582	天地科技	21,300	67,947.00	0.04

495	600835	上海机电	4,100	67,937.00	0.04
496	603077	和邦生物	45,400	67,192.00	0.04
497	000826	启迪环境	7,300	67,014.00	0.04
498	002221	东华能源	8,500	65,960.00	0.04
499	600037	歌华有线	7,061	63,619.61	0.04
500	002424	贵州百灵	7,200	62,712.00	0.04
501	000681	视觉中国	3,600	62,064.00	0.04

### 8.3.2 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

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	601916	浙商银行	294,195.00	1,370,948.70	0.87
2	688366	昊海生科	2,711.00	216,283.58	0.14
3	688181	八亿时空	2,631.00	115,711.38	0.07
4	688081	兴图新科	3,153.00	88,946.13	0.06
5	002972	科安达	1,075.00	21,532.25	0.01
6	002973	侨银环保	1,146.00	6,578.04	0.00

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	4,931,408.00	4.58
2	000661	长春高新	3,865,142.00	3.59
3	002415	海康威视	3,095,875.32	2.87
4	000002	万科 A	2,542,134.00	2.36
5	000001	平安银行	2,462,524.00	2.29
6	601916	浙商银行	2,076,173.32	1.93
7	300498	温氏股份	1,995,504.00	1.85
8	000333	美的集团	1,938,526.66	1.80
9	000651	格力电器	1,758,678.00	1.63
10	300760	迈瑞医疗	1,501,646.00	1.39
11	002304	洋河股份	1,483,070.98	1.38
12	300750	宁德时代	1,469,000.00	1.36
13	002916	深南电路	1,439,478.80	1.34
14	600519	贵州茅台	1,432,818.00	1.33
15	001979	招商蛇口	1,379,668.34	1.28

16	002475	立讯精密	1,355,772.00	1.26
17	002714	牧原股份	1,273,416.00	1.18
18	000725	京东方 A	1,268,110.00	1.18
19	002142	宁波银行	1,258,795.19	1.17
20	000568	泸州老窖	1,209,278.00	1.12

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。

#### 8.4.2 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	000661	长春高新	3,885,907.00	3.61
2	000858	五粮液	3,693,314.00	3.43
3	002415	海康威视	3,031,539.82	2.81
4	000002	万科 A	2,740,732.80	2.54
5	000333	美的集团	2,719,284.00	2.52
6	600519	贵州茅台	2,649,159.00	2.46
7	000001	平安银行	2,403,112.04	2.23
8	000651	格力电器	1,617,157.69	1.50
9	002304	洋河股份	1,563,848.58	1.45
10	002916	深南电路	1,331,797.15	1.24
11	001979	招商蛇口	1,288,015.00	1.20
12	002475	立讯精密	1,211,700.35	1.12
13	000725	京东方 A	1,202,516.00	1.12
14	002142	宁波银行	1,145,682.50	1.06
15	300760	迈瑞医疗	1,117,148.00	1.04
16	002594	比亚迪	1,101,862.00	1.02
17	002714	牧原股份	1,098,469.00	1.02
18	000538	云南白药	1,022,987.74	0.95
19	002024	苏宁易购	1,016,312.00	0.94
20	000063	中兴通讯	1,015,781.00	0.94

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	126,588,693.87
卖出股票的收入（成交）总额	115,583,365.50

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。

#### **8.5 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。

#### **8.6 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。

#### **8.7 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。

#### **8.8 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投资。

#### **8.9 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**

本报告期本基金未持有权证投资。

#### **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **8.10.1 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。

##### **8.10.2 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。

#### **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金合同无国债期货投资政策。

##### **8.11.2 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。

## 8.12 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 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。

## 8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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。

8.13.2 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之外的股票。

### 8.13.3 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	30,388.72
2	应收证券清算款	35,070.32
3	应收股利	-
4	应收利息	905.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,364.27

### 8.13.4 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五名积极投资中不存在流通受限情况。

### 8.13.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。



## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 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
128	946,036.25	117,357,440.00	96.92%	3,735,200.00	3.08%

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国农业银行股份有限公司—新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金	113,580,800.00	93.80%
2	中信证券股份有限公司	3,763,640.00	3.11%
3	苗惠	753,800.00	0.62%
4	孙楠	490,000.00	0.40%
5	张卫红	300,000.00	0.25%
6	黄志辉	167,100.00	0.14%
7	薛良正	150,000.00	0.12%
8	郑成卓	150,000.00	0.12%
9	陈鹏	100,000.00	0.08%
10	李之余	100,000.00	0.08%

## 9.3 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%

## 9.4 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

## §10 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	204,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	198,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	121,092,640.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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，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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 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。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所情况。报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。

审计年限为 1 年。自 2019 年，瑞华会计师事务所为本基金提供 1 年审计服务。

### 11.7 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，本基金无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	161,548,564.95	68.00%	29,345.45	32.73%	-
西藏东方财富证券	2	28,059,946.46	11.81%	20,519.86	22.89%	-
国盛证券	2	7,340,176.64	3.09%	5,367.29	5.99%	-
中信证券	2	6,211,675.09	2.61%	5,785.34	6.45%	-
兴业证券	1	6,071,430.45	2.56%	5,654.26	6.31%	-
中泰证券	2	5,375,707.60	2.26%	4,846.47	5.41%	-
东吴证券	1	4,180,925.66	1.76%	3,057.48	3.41%	-
中金公司	1	4,099,857.68	1.73%	3,818.35	4.26%	-
天风证券	1	3,307,521.00	1.39%	2,418.68	2.70%	-
浙商证券	1	3,163,688.83	1.33%	2,313.69	2.58%	-
东兴证券	2	1,657,322.24	0.70%	1,211.84	1.35%	-
银河证券	1	1,262,679.00	0.53%	923.33	1.03%	-
中银国际证券	2	984,971.00	0.41%	720.26	0.80%	-
民生证券	2	859,161.33	0.36%	628.39	0.70%	-
申万宏源	1	809,013.26	0.34%	753.48	0.84%	-
国金证券	1	509,037.44	0.21%	474.09	0.53%	-
恒泰证券	2	429,136.49	0.18%	338.85	0.38%	-
中信建投	1	424,423.75	0.18%	310.35	0.35%	-
招商证券	1	411,747.00	0.17%	383.44	0.43%	-

国泰君安	1	352,384.25	0.15%	328.19	0.37%	-
新时代证券	2	314,496.00	0.13%	292.88	0.33%	-
安信证券	1	156,006.52	0.07%	114.04	0.13%	-
光大证券	1	44,697.00	0.02%	41.63	0.05%	-

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45个交易席位，其中报告期内新增2个交易席位，退租1个交易席位。其中新增席位为：西藏东方财富证券上海席位和深圳席位。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。

### 11.8.2 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
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

### 11.9 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	证券日报、公司网站	2019-02-14

	金持有的信威集团估值方法调整的公告		
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
9	新华基金管理股份有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证券报、公司网站	2019-07-04
10	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 2 季度报告	证券时报、公司网站	2019-07-19
11	新华基金管理股份有限公司关于新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金增加中泰证券股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、公司网站	2019-07-23
12	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 3 季度报告	公司网站、电子信披网站	2019-10-24
13	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2019-10-24
14	新华基金管理股份有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 43 只基金基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2019-12-13
15	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）全文	公司网站	2019-12-13
16	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	公司网站	2019-12-13
17	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）全文	公司网站、电子信披网站	2019-12-27
18	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、电子信披网站	2019-12-27

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20190313-20190902	2,985,000.00	-	2,985,000.00	0.00	0.00%
其他	1	20190903-20191231	0.00	191,580,800.00	78,000,000.00	113,580,800.00	93.80%
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>							

### 12.2 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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基金合同》
- (四)《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》
- (五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (六)更新的《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)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

(十)中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 13.3 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

二〇二〇年三月二十六日