

# 新华中证环保产业指数分级证券投资基金

## 2020 年中期报告

### 2020 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：二〇二〇年八月二十七日

## 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。本中期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 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	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 主要财务指标和基金净值表现</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
<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遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
<b>5 托管人报告</b> .....	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
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.....	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	56
7.1 期末基金资产组合情况.....	56
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	58
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	63
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	67
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	67
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	68
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	68
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
7.11 投资组合报告附注.....	70
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	74
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	75
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>77</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>78</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
10.4 基金投资策略的改变.....	78
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	78
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.....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
10.8 其他重大事件.....	79
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>81</b>
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>81</b>
12.1 备查文件目录.....	81
12.2 存放地点.....	81
12.3 查阅方式.....	81

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华中证环保产业指数分级证券投资基金		
基金简称	新华中证环保产业指数分级		
场内简称	新华环保		
基金主代码	164304		
交易代码	164304		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 9 月 11 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	46,431,857.21 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2014 年 10 月 16 日		
下属分级基金的基金简称	新华环保 A	新华环保 B	新华环保
下属分级基金的场内简称	NCF 环保 A	NCF 环保 B	新华环保
下属分级基金的交易代码	150190	150191	164304
报告期末下属分级基金的份额总额	5,881,303.00 份	5,881,303.00 份	34,669,251.21 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,以实现对标指数的有效跟踪。在正常市场情况下,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%		
投资策略	本基金为指数型基金,原则上采用完全复制法,按照成份股在中证环保产业指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对实际投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	95%×中证环保产业指数收益率 +5%×商业银行活期存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金是指数型基金,具有较高预期收益、较高预期风险的特征。预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 从本基金的基金份额来看,新华环保 A 份额为稳健收益类份额,具有低预期风险且预期收益相对较低的特征;新华环保 B 份额为积极收益类份额,具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	低预期风险且预期收益相对较低。	高预期风险且预期收益相对较高的。	较高预期收益、较高预期风险。

注：本基金份额上市的证券交易所为深圳证券交易所，A 类上市简称：NCF 环保 A，上市交易代码：150190，B 类上市简称：NCF 环保 B，上市交易代码：150191。

## 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	李申
	联系电话	010-68779688	021-60637102
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008198866	021-60637111
传真		010-68779528	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		400010	100033
法定代表人		张宗友	田国立

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 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（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	-2,069,080.75
本期利润	4,634,956.64
加权平均基金份额本期利润	0.0937
本期加权平均净值利润率	7.84%

本期基金份额净值增长率	7.95%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2020年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-24,665,373.88
期末可供分配基金份额利润	-0.5312
期末基金资产净值	58,606,548.03
期末基金份额净值	1.262
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2020年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-8.43%

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）。

4、本基金于 2014 年 9 月 11 日基金合同生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 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	9.83%	0.84%	9.42%	0.83%	0.41%	0.01%
过去三个月	15.25%	1.16%	13.98%	1.16%	1.27%	0.00%
过去六个月	7.95%	1.80%	6.69%	1.80%	1.26%	0.00%
过去一年	13.16%	1.45%	12.20%	1.45%	0.96%	0.00%
过去三年	-22.38%	1.41%	-19.95%	1.40%	-2.43%	0.01%
自基金合同生效起至今	-8.43%	1.85%	-3.17%	1.74%	-5.26%	0.11%

注：1、本基金的业绩比较基准为 95%×中证环保产业指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。由于本基金的投资标的为中证环保产业指数，且本基金现金或者到期日在一年之内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此本基金将业绩比较基准定为 95%×中证环保产业指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。

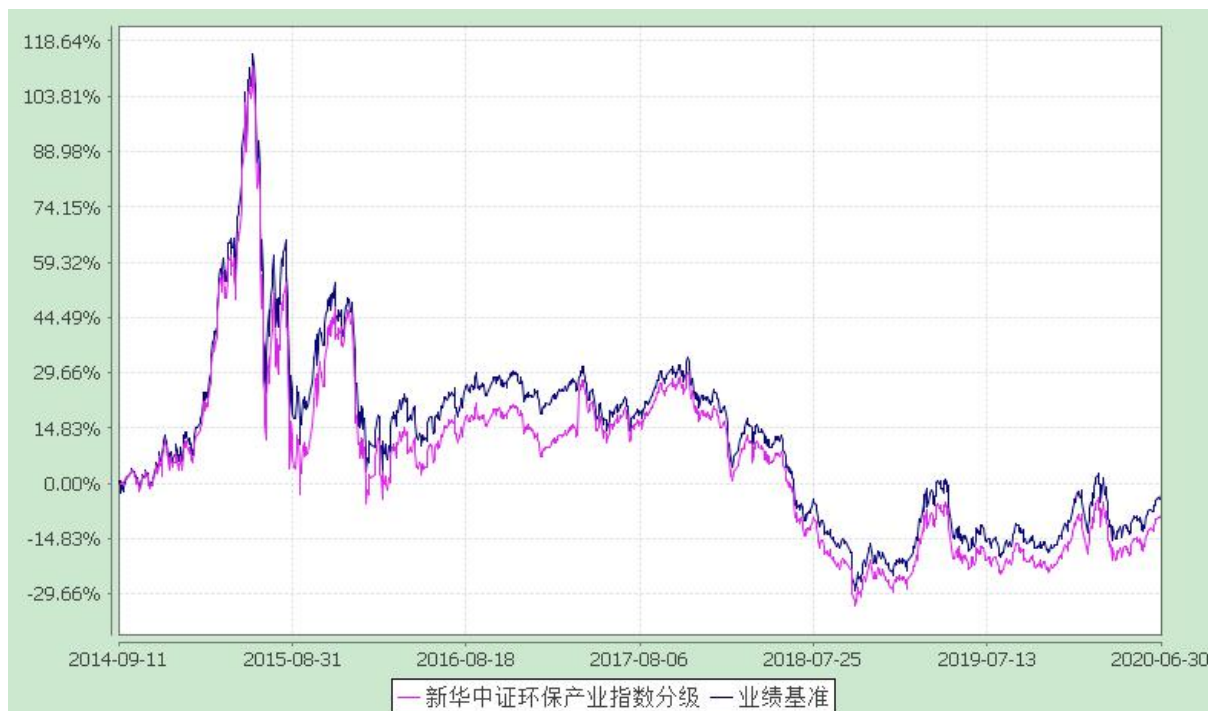
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

## 新华中证环保产业指数分级证券投资基金

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历史走势对比图  
(2014 年 9 月 11 日至 2020 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2014 年 9 月 11 日生效。报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2020 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十五只开放式基金，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、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）。

#### 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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数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	2017-08-07	-	12	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。

	经理。				
熊俊杰	本基金基金经理助理，新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理助理、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经理助理、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助理。	2020-06-19	-	4	金融数学硕士，历任金贝塔网络金融科技（深圳）量化研究员，招商期货量化研究员，新华基金量化研究员，主要负责量化选股、择时、行业轮动、资产配置等领域研究。

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华中证环保产业指数分级证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华中证环保产业指数分级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《证券投资基金管理有限公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易，投资指令统一由交易部下达，并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度，严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中，对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易，交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议，由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段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

本基金为指数基金，以对标的指数的有效跟踪为投资目标。

2020 年上半年，本基金采用完全复制的被动式指数投资方法，避免不必要的交易，产品紧密跟踪了指数的走势，保持了较小的跟踪误差。报告期内，标的指数发生一次成分股调整，本基金根据成份股及其权重的变动，在有效地控制了跟踪误差的情况下，平稳地完成了调整。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.262 元，本报告期份额净值增长率为 7.95%，同期比较基准的增长率为 6.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部门、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

## 二、基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部门相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

## 三、投资管理部门的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

#### 四、交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

#### 五、监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资管理部门问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：新华中证环保产业指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	3,329,597.70	3,354,332.25
结算备付金		760.97	-
存出保证金		3,474.61	1,687.83
交易性金融资产	6.4.7.2	56,095,805.44	60,212,499.35
其中：股票投资		56,095,805.44	60,212,499.35
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		21,459.99	277,118.19
应收利息	6.4.7.5	592.48	679.78
应收股利		-	-
应收申购款		173,383.07	17,472.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>59,625,074.26</b>	<b>63,863,789.91</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		777,061.62	199,593.59

应付管理人报酬		47,405.18	52,873.51
应付托管费		10,429.15	11,632.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	33,021.43	22,668.85
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	150,608.85	200,516.33
负债合计		1,018,526.23	487,284.44
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	63,992,356.43	74,712,868.38
未分配利润	6.4.7.10	-5,385,808.40	-11,336,362.91
所有者权益合计		58,606,548.03	63,376,505.47
负债和所有者权益总计		59,625,074.26	63,863,789.91

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，新华环保份额净值 1.262 元，新华环保 A 份额参考净值 1.027 元，新华环保 B 份额参考净值 1.497 元；基金份额总额 46,431,857.21 份，下属分级基金的份额总额分别为：新华环保份额总额 34,669,251.21 份，新华环保 A 份额总额 5,881,303.00 份，新华环保 B 份额总额 5,881,303.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华中证环保产业指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>5,248,876.94</b>	<b>9,645,072.18</b>
1.利息收入		12,142.45	14,741.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,142.45	14,741.80
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,478,799.28	-15,423,474.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,802,214.11	-15,813,886.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.13	323,414.83	390,411.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	6,704,037.39	25,033,009.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	11,496.38	20,795.93
<b>减：二、费用</b>		<b>613,920.30</b>	<b>709,665.92</b>
1. 管理人报酬		294,864.62	348,631.38
2. 托管费		64,870.20	76,698.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.16	63,452.66	84,806.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.17	190,732.82	199,529.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4,634,956.64</b>	<b>8,935,406.26</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4,634,956.64</b>	<b>8,935,406.26</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华中证环保产业指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	74,712,868.38	-11,336,362.91	63,376,505.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,634,956.64	4,634,956.64
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）	-10,720,511.95	1,315,597.87	-9,404,914.08
其中：1.基金申购款	5,885,321.50	-790,674.79	5,094,646.71
2.基金赎回款	-16,605,833.45	2,106,272.66	-14,499,560.79
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）	63,992,356.43	-5,385,808.40	58,606,548.03
项目	上年度可比期间		
	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）	93,169,287.38	-26,054,203.40	67,115,083.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,935,406.26	8,935,406.26
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）	-13,822,176.73	2,005,856.19	-11,816,320.54
其中：1.基金申购款	6,856,006.50	-988,112.80	5,867,893.70
2.基金赎回款	-20,678,183.23	2,993,968.99	-17,684,214.24
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）	79,347,110.65	-15,112,940.95	64,234,169.70

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：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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

新华中证环保产业指数分级证券投资基金(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[2014]513号《关于核准新华中证环保产业指数分级证券投资基金募集的批复》的批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于2014年8月11日至2014年9月5日向社会公开募集的契约型开放式股票型证券投资基金。首次募集资金总额983,956,241.31元,其中募集净认购资金金额983,784,772.57元,募集期银行利息折算基金金额为171,468.74元,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2014]37100030号验资报告予以验证。2014年9月11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,存续期为不定期,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，新华中证环保产业指数分级证券投资基金包括新华中证环保产业指数分级证券投资基金之基础份额（即“新华环保份额”）、新华中证环保产业指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“新华环保 A 份额”）与新华中证环保产业指数分级证券投资基金之积极收益份额（即“新华环保 B 份额”）。其中新华环保 A 份额、新华环保 B 份额配比始终保持 1:1 的比例不变。基金发售结束后，本基金将投资人在场内认购的全部新华环保份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别，即新华环保 A 份额和新华环保 B 份额。基金合同生效后，新华环保份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。新华环保 A 份额与新华环保 B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可进行申购或赎回。

在新华环保 A 份额、新华环保份额存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将进行定期份额折算。对于新华环保 A 份额的约定收益，即新华环保 A 份额每个会计年度 12 月 31 日的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内新华环保份额分配给新华环保 A 份额持有人。新华环保份额持有人持有的每 2 份新华环保份额将按 1 份新华环保 A 份额获得新增新华环保份额的分配。在基金份额折算前与折算后，新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当新华环保份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上；当新华环保 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元以下。份额折算后本基金将确保新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的比例为 1:1，份额折算后新华环保 A 份额的基金份额参考净值、新华环保 B 份额的基金份额参考净值和新华环保份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2014]358 号核准，本基金 NCF 环保 A：355,223,540.00 份、NCF 环保 B：355,223,540.00 份于 2014 年 10 月 16 日在深交所上市交易，未上市交易的新华环保办理跨系统转托管到场内（证券登记结算系统）后，根据基金合同配对转换的规定申请将份额分拆成 NCF 环保 A 和 NCF 环保 B，分拆后的 NCF 环保 A 和 NCF 环保 B 可以在深圳证券交易所场内上市流通。

根据《新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书》及《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金可投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股等股票（包括中小板、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。此外，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，可以将

其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 90%—95%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金基金资产的 80%。现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本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 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 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》，《新华中证环保产业指数分级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上年度一致，会计政策与上年度一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生差错更正。

#### 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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	3,329,597.70
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,329,597.70

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	54,939,847.37	56,095,805.44	1,155,958.07
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	54,939,847.37	56,095,805.44	1,155,958.07

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

报告期末，本基金未持有买断式回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	590.86
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	1.62
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	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	592.48

注：应收结算备付金利息中包含结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

报告期末，本基金未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	33,021.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	33,021.43

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,210.47
应付证券出借违约金	-
其他应付款	-
预提费用	109,398.38
指数使用费	40,000.00
合计	150,608.85

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	52,987,953.81	74,712,868.38
本期申购	7,941.94	11,197.57
本期赎回（以“-”号填列）	-34,146.47	-48,144.23
-基金拆分/份额折算前	52,961,749.28	74,675,921.72
基金拆分/份额折算调整	1,222,006.68	—
本期申购	4,262,257.90	5,874,123.93
本期赎回（以“-”号填列）	-12,014,156.65	-16,557,689.22
本期末	46,431,857.21	63,992,356.43

注：1、根据本基金基金合同规定，投资者可申购、赎回新华环保份额，新华环保 A 份额和新华环保 B 份额不能单独申购赎回，只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露新华环保 A 份额和新华环保 B 份额的情况。报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 46,431,857.21 份，其中新华环保份额 34,669,251.21 份，新华环保 A 份额 5,881,303.00 份，新华环保 B 份额 5,881,303.00 份。

2、根据本基金基金合同的相关规定，本基金于 2020 年 1 月 2 日进行了定期折算。基金拆分份额调整包括一次折算的份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-26,458,403.09	15,122,040.18	-11,336,362.91
本期利润	-2,069,080.75	6,704,037.39	4,634,956.64
本期基金份额交易产生的变动数	3,862,109.96	-2,546,512.09	1,315,597.87
其中：基金申购款	-2,120,172.12	1,329,497.33	-790,674.79
基金赎回款	5,982,282.08	-3,876,009.42	2,106,272.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,665,373.88	19,279,565.48	-5,385,808.40

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	11,996.73
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	145.72
其他	-
合计	12,142.45

注：应收结算备付金利息中包含结算保证金利息。

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	26,910,350.42
减：卖出股票成本总额	28,712,564.53
买卖股票差价收入	-1,802,214.11

## 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	323,414.83
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	323,414.83

## 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	6,704,037.39
——股票投资	6,704,037.39
——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	6,704,037.39

## 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	11,496.38
合计	11,496.38

## 6.4.7.16 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	63,452.66
银行间市场交易费用	-
合计	63,452.66

## 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
账户维护费	-
汇划手续费	1,334.44
上市费	29,835.26
指数使用费	80,000.00
合计	190,732.82

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1或有事项

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	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	23,600,502.91	53.39%	19,858,857.69	33.36%

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020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	17,259.73	52.91%	17,850.82	54.06%
关联方名称	上年度可比期间 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	14,489.03	33.23%	14,489.03	11.24%

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	294,864.62	348,631.38
其中：支付销售机构的客户维护费	85,200.19	95,992.59

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1%的年费率逐日计提,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%/当年天数。

2、本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	64,870.20	76,698.89

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.22% 的年费率逐日计提，按月支付。

其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金与关联方未进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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

报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019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	3,329,597.70	11,996.73	3,831,751.76	14,456.47

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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

30084 3	胜蓝 股份	2020-0 6-23	2020-0 7-02	网下 中签	10.01	10.01	751.00	7,517. 51	7,517. 51	-
30084 5	捷安 高科	2020-0 6-24	2020-0 7-03	网下 中签	17.63	17.63	392.00	6,910. 96	6,910. 96	-
30084 6	首都 在线	2020-0 6-22	2020-0 7-01	网下 中签	3.37	3.37	1,131. 00	3,811. 47	3,811. 47	-

#### 6.4.12.2 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股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

##### 6.4.12.3.2 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余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金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。

##### 6.4.13.2.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 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。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	3,329,597.70	-	-	-	3,329,597.70
结算备付金	760.97	-	-	-	760.97
存出保证金	3,474.61	-	-	-	3,474.61
交易性金融资产	-	-	-	56,095,805.44	56,095,805.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	21,459.99	21,459.99
应收利息	-	-	-	592.48	592.48
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	173,383.07	173,383.07
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,333,833.28	-	-	56,291,240.98	59,625,074.26
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	-	-	-	777,061.62	777,061.62
应付管理人报酬	-	-	-	47,405.18	47,405.18
应付托管费	-	-	-	10,429.15	10,429.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	33,021.43	33,021.43
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	150,608.85	150,608.85
负债总计	-	-	-	1,018,526.23	1,018,526.23
利率敏感度缺口	3,333,833.28	-	-	55,272,714.75	58,606,548.03
上年度末 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	3,354,332.25	-	-	-	3,354,332.25
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	1,687.83	-	-	-	1,687.83
交易性金融资产	-	-	-	60,212,499.35	60,212,499.35
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	277,118.19	277,118.19
应收利息	-	-	-	679.78	679.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	17,472.51	17,472.51
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,356,020.08	-	-	60,507,769.83	63,863,789.91
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	-	-	-	199,593.59	199,593.59
应付管理人报酬	-	-	-	52,873.51	52,873.51
应付托管费	-	-	-	11,632.16	11,632.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	22,668.85	22,668.85
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	200,516.33	200,516.33
负债总计	-	-	-	487,284.44	487,284.44
利率敏感度缺口	3,356,020.08	-	-	60,020,485.39	63,376,505.47

注：1.表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2.本期末“其他负债”包含“应付指数使用费”。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析



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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	56,095,805.4 4	95.72	60,212,499.35	95.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	56,095,805.4 4	95.72	60,212,499.35	95.01

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升或下降 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
沪深300指数上升1%	624,540.31	630,231.29
沪深300指数下降1%	-624,540.31	-630,231.29

#### 6.4.14 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	56,095,805.44	94.08
	其中：股票	56,095,805.44	94.08
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	3,330,358.67	5.59
8	其他各项资产	198,910.15	0.33
9	合计	59,625,074.26	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,753,926.89	64.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,042,726.66	13.72
E	建筑业	1,571,709.77	2.68
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	2,177,954.00	3.72
J	金融业	-	-
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	5,853,628.96	9.99
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	624,634.00	1.07
	合计	56,024,580.28	95.59

### 7.2.2 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	52,841.93	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,660.80	0.01
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	10,722.43	0.02
J	金融业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	71,225.16	0.12

### 7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期末，本基金未持有港股通投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 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	600884	杉杉股份	61,500	725,085.00	1.24
2	601865	福莱特	37,300	701,240.00	1.20
3	601012	隆基股份	16,696	680,028.08	1.16
4	603806	福斯特	13,381	667,845.71	1.14
5	300037	新宙邦	12,100	666,226.00	1.14
6	002459	晶澳科技	35,400	664,812.00	1.13
7	300014	亿纬锂能	13,699	655,497.15	1.12
8	300751	迈为股份	2,200	653,312.00	1.11
9	002745	木林森	41,800	644,138.00	1.10
10	300274	阳光电源	44,462	639,808.18	1.09
11	300618	寒锐钴业	10,280	637,565.60	1.09
12	002850	科达利	9,100	629,720.00	1.07

13	300724	捷佳伟创	7,100	628,563.00	1.07
14	600438	通威股份	36,100	627,418.00	1.07
15	000009	中国宝安	73,400	624,634.00	1.07
16	300118	东方日升	41,100	616,500.00	1.05
17	002709	天赐材料	18,080	610,923.20	1.04
18	300750	宁德时代	3,500	610,260.00	1.04
19	300073	当升科技	18,400	608,488.00	1.04
20	300207	欣旺达	32,000	604,800.00	1.03
21	002129	中环股份	26,700	599,682.00	1.02
22	002028	思源电气	29,300	599,478.00	1.02
23	600563	法拉电子	9,700	599,460.00	1.02
24	300316	晶盛机电	23,860	590,296.40	1.01
25	002340	格林美	117,932	586,122.04	1.00
26	603799	华友钴业	15,030	584,065.80	1.00
27	603218	日月股份	31,900	583,770.00	1.00
28	002080	中材科技	37,366	579,173.00	0.99
29	603659	璞泰来	5,600	576,912.00	0.98
30	002460	赣锋锂业	10,700	573,199.00	0.98
31	600116	三峡水利	64,300	571,627.00	0.98
32	300776	帝尔激光	6,780	568,028.40	0.97
33	600900	长江电力	29,795	564,317.30	0.96
34	300376	易事特	108,500	564,200.00	0.96
35	300815	玉禾田	4,600	564,144.00	0.96
36	603568	伟明环保	24,231	562,159.20	0.96
37	600406	国电南瑞	27,672	560,358.00	0.96
38	002056	横店东磁	49,588	557,865.00	0.95
39	601877	正泰电器	21,155	557,434.25	0.95
40	000035	中国天楹	109,229	557,067.90	0.95
41	300457	赢合科技	17,450	556,306.00	0.95
42	603421	鼎信通讯	36,900	552,762.00	0.94
43	601222	林洋能源	100,900	550,914.00	0.94
44	002973	侨银环保	23,500	550,840.00	0.94
45	300450	先导智能	11,900	549,899.00	0.94
46	600674	川投能源	59,234	549,099.18	0.94
47	300072	三聚环保	128,116	548,336.48	0.94
48	300001	特锐德	26,100	546,534.00	0.93
49	600025	华能水电	144,000	545,760.00	0.93
50	000591	太阳能	161,000	544,180.00	0.93
51	603515	欧普照明	19,790	541,652.30	0.92
52	300296	利亚德	89,134	541,043.38	0.92
53	300070	碧水源	66,568	540,532.16	0.92
54	300682	朗新科技	31,700	539,534.00	0.92
55	601615	明阳智能	43,200	537,840.00	0.92
56	600886	国投电力	68,200	536,052.00	0.91

57	002531	天顺风能	89,580	535,688.40	0.91
58	003816	中国广核	180,500	534,280.00	0.91
59	002506	协鑫集成	204,200	532,962.00	0.91
60	600388	龙净环保	60,556	532,892.80	0.91
61	600021	上海电力	71,999	532,792.60	0.91
62	300068	南都电源	49,900	531,934.00	0.91
63	000400	许继电气	40,142	529,874.40	0.90
64	601330	绿色动力	55,700	529,150.00	0.90
65	601200	上海环境	44,080	528,960.00	0.90
66	601985	中国核电	129,300	528,837.00	0.90
67	002466	天齐锂业	23,000	527,850.00	0.90
68	600517	国网英大	78,900	527,052.00	0.90
69	000690	宝新能源	111,544	526,487.68	0.90
70	601727	上海电气	104,460	526,478.40	0.90
71	600874	创业环保	79,136	525,463.04	0.90
72	601016	节能风电	247,812	525,361.44	0.90
73	601611	中国核建	85,000	525,300.00	0.90
74	300365	恒华科技	51,500	525,300.00	0.90
75	600312	平高电气	70,700	524,594.00	0.90
76	600703	三安光电	20,982	524,550.00	0.90
77	600008	首创股份	174,162	524,227.62	0.89
78	600068	葛洲坝	88,100	524,195.00	0.89
79	600487	亨通光电	31,900	523,479.00	0.89
80	002202	金风科技	52,476	523,185.72	0.89
81	002310	东方园林	108,119	522,214.77	0.89
82	600549	厦门钨业	44,100	522,144.00	0.89
83	600875	东方电气	58,925	521,486.25	0.89
84	600869	智慧能源	130,300	521,200.00	0.89
85	300203	聚光科技	31,110	520,470.30	0.89
86	000967	盈峰环境	62,900	518,925.00	0.89
87	000598	兴蓉环境	112,463	517,329.80	0.88
88	600483	福能股份	71,200	516,912.00	0.88
89	600323	瀚蓝环境	23,590	516,149.20	0.88
90	000826	启迪环境	69,541	515,994.22	0.88
91	600482	中国动力	32,800	514,960.00	0.88
92	600089	特变电工	75,920	513,978.40	0.88
93	300232	洲明科技	63,313	512,202.17	0.87
94	601179	中国西电	105,700	511,588.00	0.87
95	002266	浙富控股	131,592	509,261.04	0.87
96	600217	中再资环	104,400	503,208.00	0.86
97	002617	露笑科技	103,500	503,010.00	0.86
98	002074	国轩高科	18,600	499,224.00	0.85
99	002665	首航高科	203,366	496,213.04	0.85
100	300495	美尚生态	49,339	469,707.28	0.80

## 7.3.2 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	300842	帝科股份	455.00	18,527.60	0.03
2	603087	甘李药业	150.00	15,045.00	0.03
3	300839	博汇股份	502.00	11,751.82	0.02
4	600956	新天绿能	1,520.00	7,660.80	0.01
5	300843	胜蓝股份	751.00	7,517.51	0.01
6	300845	捷安高科	392.00	6,910.96	0.01
7	300846	首都在线	1,131.00	3,811.47	0.01

## 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	600563	法拉电子	568,686.00	0.90
2	300815	玉禾田	560,393.00	0.88
3	003816	中国广核	557,436.00	0.88
4	300365	恒华科技	556,740.00	0.88
5	600312	平高电气	555,436.00	0.88
6	300751	迈为股份	553,856.00	0.87
7	002973	侨银环保	550,202.00	0.87
8	600217	中再资环	548,635.00	0.87
9	002028	思源电气	548,137.00	0.86
10	300682	朗新科技	545,250.00	0.86
11	002074	国轩高科	544,921.00	0.86
12	000009	中国宝安	541,622.00	0.85
13	603421	鼎信通讯	541,564.00	0.85
14	601179	中国西电	541,524.00	0.85
15	600517	国网英大	540,562.00	0.85
16	002617	露笑科技	540,068.00	0.85
17	601611	中国核建	539,339.00	0.85
18	300068	南都电源	537,265.00	0.85
19	600869	智慧能源	536,128.00	0.85
20	600487	亨通光电	535,632.00	0.85

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	002594	比亚迪	808,734.79	1.28
2	002384	东山精密	749,484.00	1.18
3	300124	汇川技术	686,438.59	1.08
4	603693	江苏新能	675,919.00	1.07
5	000581	威孚高科	632,704.08	1.00
6	600733	北汽蓝谷	628,222.00	0.99
7	300724	捷佳伟创	616,839.00	0.97
8	000012	南玻 A	590,312.20	0.93
9	600803	新奥股份	582,050.00	0.92
10	002372	伟星新材	569,246.95	0.90
11	002611	东方精工	563,591.00	0.89
12	002717	岭南股份	561,417.70	0.89
13	002249	大洋电机	557,079.26	0.88
14	002341	新纶科技	555,755.00	0.88
15	300323	华灿光电	551,165.00	0.87
16	300284	苏交科	531,830.60	0.84
17	600236	桂冠电力	507,322.70	0.80
18	002573	清新环境	495,836.80	0.78
19	002610	爱康科技	492,850.00	0.78
20	600066	宇通客车	485,353.00	0.77

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

## 7.4.3 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	17,891,833.23
卖出股票的收入（成交）总额	26,910,350.42

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

## 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

报告期末，本基金未持有债券。



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

报告期末，本基金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**

报告期末，本基金未持有贵金属。

**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**

报告期末，本基金未持有权证。

**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**

本基金合同尚无股指期货投资政策。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末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。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定。

**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	3,474.61
2	应收证券清算款	21,459.99

3	应收股利	-
4	应收利息	592.48
5	应收申购款	173,383.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	198,910.15

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

报告期末，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	300843	胜蓝股份	7,517.51	0.01	网下新股未上市

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
新华环保 A	361	16,291.70	3,829,258.00	65.11%	2,052,045.00	34.89%
新华环保 B	2,833	2,076.00	53,985.00	0.92%	5,827,318.00	99.08%
新华环保	10,699	3,240.42	636,353.10	1.84%	34,032,898.11	98.16%
合计	13,893	3,342.10	4,519,596.10	9.73%	41,912,261.11	90.27%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 新华环保 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	2,637,970.00	44.85%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	1,191,288.00	20.26%
3	施鸿宇	1,143,249.00	19.44%
4	张晓峰	150,000.00	2.55%
5	朱洪宏	125,060.00	2.13%
6	陈才梅	80,000.00	1.36%
7	李冰	70,200.00	1.19%
8	方春娣	67,203.00	1.14%
9	相建	51,218.00	0.87%
10	赖明理	49,535.00	0.84%

### 新华环保B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	王安成	650,754.00	11.06%
2	朱洪宏	507,489.00	8.63%

3	欧静虹	282,028.00	4.80%
4	邵立忠	206,946.00	3.52%
5	欧贤茂	134,161.00	2.28%
6	姜秀芝	108,736.00	1.85%
7	陈亚萍	93,667.00	1.59%
8	朱杰	87,922.00	1.49%
9	赵立忠	64,228.00	1.09%
10	俞世平	50,278.00	0.85%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	新华环保 A	0.00	0.00%
	新华环保 B	0.00	0.00%
	新华环保	782.73	0.00%
	合计	782.73	0.00%

### 8.4 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	份额级别	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	新华环保 A	0
	新华环保 B	0
	新华环保	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华环保 A	0
	新华环保 B	0
	新华环保	0
	合计	0

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

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华环保 A	新华环保 B	新华环保
基金合同生效日（2014 年 9 月 11 日）基金份额总额	356,621,249.00	356,621,249.00	270,710,462.83
本报告期期初基金份额总额	6,576,995.00	6,576,995.00	39,833,963.81
本报告期基金总申购份额	-	-	4,270,199.84
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	12,048,303.12
本报告期基金拆分变动份额	-695,692.00	-695,692.00	2,613,390.68

本报告期末基金份额总额	5,881,303.00	5,881,303.00	34,669,251.21
-------------	--------------	--------------	---------------

注：拆分变动份额包括三类份额之间的配对转换份额、定期折算和不定期折算调整份额。

## 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

本报告期，本基金基金管理人聘任翟晨曦女士担任公司董事职务，胡湘先生、刘成伟先生担任公司独立董事职务，副总经理崔建波、晏益民离任。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未发生改聘会计师事务所的情况。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

恒泰证券	2	23,600,502.91	53.39%	17,259.73	52.91%	-
华安证券	2	13,069,925.67	29.57%	9,559.58	29.31%	-
华创证券	1	3,188,471.28	7.21%	2,331.27	7.15%	-
广发证券	1	1,553,672.41	3.52%	1,136.27	3.48%	-
银河证券	1	1,266,382.24	2.87%	1,179.21	3.61%	-
中信建投证券	1	1,021,698.84	2.31%	747.22	2.29%	-
安信证券	2	210,011.50	0.48%	153.61	0.47%	-
国金证券	1	207,241.56	0.47%	193.13	0.59%	-
东北证券	1	52,518.44	0.12%	38.40	0.12%	-
华西证券	2	30,168.77	0.07%	22.05	0.07%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用 22 个交易席位，其中报告期内新增 7 个交易席位，退租 0 个交易席位。其中新增席位为：华安证券上海席位、华西证券上海席位、安信证券上海席位、大同证券上海席位、华安证券深圳席位、华西证券深圳席位、大同证券深圳席位。

#### 一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

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

#### 二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

#### 三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

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

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

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间新华环保 A 份额停复牌的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-01-03
2	关于新华环保 A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-01-06
3	关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-01-06
4	关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金之新华环保 A 份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-01-06
5	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司调整基金最低申购金额的公告	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	2020-01-10
6	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金	中国证券报、上海证券	2020-01-20

	2019 年第 4 季度报告提示性公告	报、证券时报、证券日报、 公司网站、电子信披网站	
7	新华中证环保产业指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-01-20
8	关于新华中证环保产业指数分级证券投资基金 暂停场内申购业务的公告	证券时报、公司网站、电 子信披网站	2020-03-23
9	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年年度报告提示性公告	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	2020-03-26
10	新华中证环保产业指数分级证券投资基金 2019 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2020-03-26
11	新华基金管理股份有限公司关于董事及独董 变更的公告	中国证券报、公司网站、 电子信披网站	2020-03-27
12	新华基金管理股份有限公司关于参加恒泰证 券股份有限公司费率优惠活动的公告	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	2020-04-08
13	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年第 1 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	2020-04-21
14	新华中证环保产业指数分级证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-04-21
15	新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增 加中信证券华南股份有限公司为销售机构并 开通定期定额投资业务及基金转换业务的公 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	2020-04-30
16	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基 金增加民商基金销售(上海)有限公司为代 销机构并开通基金转换业务及参加网上费 率优惠活动的公告	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	2020-05-27
17	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	中国证券报、公司网站、 电子信披网站	2020-06-06
18	新华基金管理股份有限公司关于取消武汉 市伯嘉基金销售有限公司为销售机构的公 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	2020-06-20
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分 基金增加泛华普益基金销售有限公司为代 销机构并开通基金转换业务及参加网上费 率优惠活动的公告	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	2020-06-24
20	新华基金管理股份有限公司关于取消厦 门市鑫鼎盛控股有限公司为销售机构的公 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	2020-06-30



## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准新华中证环保产业指数分级证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华中证环保产业指数分级证券投资基金之法律意见书
- (三)新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同
- (四)新华中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议
- (五)新华中证环保产业指数分级证券投资基金登记结算服务协议
- (六)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (七)更新的《新华中证环保产业指数分级证券投资基金招募说明书》
- (八)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程
- (九)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (十)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
- (十一)中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二〇年八月二十七日

