

新华红利回报混合型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	错误!未定义书签。
2.2 基金产品说明.....	错误!未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人.....	错误!未定义书签。
2.4 信息披露方式.....	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	错误!未定义书签。
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	错误!未定义书签。
3.2 基金净值表现.....	错误!未定义书签。
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	错误!未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	错误!未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	错误!未定义书签。
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	错误!未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	错误!未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	错误!未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	错误!未定义书签。
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	错误!未定义书签。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	错误!未定义书签。
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	错误!未定义书签。
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	错误!未定义书签。
6.2 利润表.....	错误!未定义书签。
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	错误!未定义书签。
6.4 报表附注.....	错误!未定义书签。
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	错误!未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	错误!未定义书签。
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.5 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	错误!未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	错误!未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	错误!未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	错误!未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。
7.13 投资组合报告附注.....	错误!未定义书签。
8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	错误!未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	错误!未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
9 开放式基金份额变动	44
10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	错误!未定义书签。
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误!未定义书签。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误!未定义书签。
10.8 其他重大事件	错误!未定义书签。
11 影响投资者决策的其他重要信息	49
12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	错误!未定义书签。
12.2 存放地点	错误!未定义书签。
12.3 查阅方式	错误!未定义书签。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华红利回报混合型证券投资基金
基金简称	新华红利回报混合
基金主代码	003025
交易代码	003025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月27日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,136,074.82 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	综合运用多种投资策略，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上追求基金资产净值的持续、稳定增长，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	投资策略方面，本基金将以大类资产配置策略为基础，采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。大类资产配置策略主要运用战略性资产配置策略和战术性资产配置策略。股票投资策略采用定量分析与定性分析相结合的方法，选取主业清晰，具有持续的核心竞争力，管理透明度较高，流动性好且估值具有高安全边际的个股构建股票组合。债券投资策略主要运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略、可转换债券投资策略等。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险中等预期收益品种，预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	郭明
	联系电话	010-68779688	010-66105799
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95588
传真		010-68779528	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街55 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55 号
邮政编码	400010	100140
法定代表人	张宗友	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	15,218,526.86
本期利润	4,954,219.18
加权平均基金份额本期利润	0.0853
本期加权平均净值利润率	7.34%
本期基金份额净值增长率	12.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	5,208,448.73
期末可供分配基金份额利润	0.1082
期末基金资产净值	53,493,131.54
期末基金份额净值	1.1113
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	57.75%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去 1 个月	2.92%	0.42%	3.26%	0.44%	-0.34%	-0.02%
过去 3 个月	11.28%	0.57%	5.45%	0.45%	5.83%	0.12%
过去 6 个月	12.87%	1.23%	1.62%	0.73%	11.25%	0.50%
过去 1 年	32.90%	1.03%	6.06%	0.59%	26.84%	0.44%
过去 3 年	55.56%	0.75%	11.55%	0.61%	44.01%	0.14%
自基金合同生效起至今	57.75%	0.72%	13.85%	0.60%	43.90%	0.12%

注：1、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*50%+中国债券总指数收益率*50%；

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

新华红利回报混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 3 月 27 日至 2020 年 6 月 30 日)



注：本报告期末,本基金各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 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		
姚秋	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司投资副总监、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理。	2017-03-27	-	11	经济学博士、注册金融分析师，历任中国建设银行北京分行投资银行部投资研究工作、中国工商银行资产管理部固定收益投资经理。
张乃先	本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、新	2020-06-03	-	6	经济学硕士，历任新华基金固定收益信用研究员、宏观研究员、高级宏观研究员。

	<p>华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理。</p>				
于航	<p>本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金</p>	2020-06-03	-	5	<p>统计学硕士，历任新华基金股票交易员，固定收益与平衡投资部研究员，从事宏观研究、策略研究、信用研究、转债研究等工作。</p>

	<p>基金经理助理、安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基</p>				
--	---	--	--	--	--

	金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理。				
--	---	--	--	--	--

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红利回报混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华红利回报混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现重大异常情况，且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，国内疫情从快速爆发到得到控制，多数行业的生产经营活动在经历了短期停滞后开始向正常状态恢复，宏观经济数据从四月份开始呈现逐月改善态势。在此背景下，货币市场的流动性水平在边际上有所收敛，股票和债券在二季度走势呈现明显分化。在资产配置方面，我们维持股债并重的策略，从股票估值与公司基本面的匹配度、债券收益率与宏观基本面的匹配度等角度出发进行大类资产和小类资产配置，依旧着力防范信用风险。股票方面，我们坚持以行业和个股的可持续估值水平为锚，根据市场总体的估值水平变化、行业之间基本面状况的对比，以及估值与基本面的匹配度，维持较高的股票总体持仓比例，保留了家电、传媒等行业以及部分制造业龙头企业的持仓，适当调低了食品饮料和医药行业的持仓，调高了部分估值偏低但基本面存在边际改善预期的行业的持仓水平，并对各行业内部结构进行了微调。债券方面，我们继续维持中等久期、哑铃型配置的策略，并在市场收益率的下行阶段，对组合久期进行了小幅调减。短久期债券方面，我们以高等级债券作为主要标的，回避存在潜在信用风险的个券；中长久期债券主要以政策性金融债为主。转债方面，我们维持较低的持仓水平，根据转股溢价率和正股吸引力的变化，进行了小幅结构调整，并继续保持对主流品种的密切跟踪。一季度组合净值波动相对较大，二季度组合表现较为稳健，绝对收益和相对收益状况符合预期水平。

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 1.1113 元，本报告期份额净值增长率为 12.87%，同期比较基准的增长率为 1.62%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计海外疫情的不利影响仍处于集中体现阶段，经济增速可能会受到内需回暖和

外需走弱的双重影响，仍具有较多的不确定性。中期来看，在地产、基建和传统制造业占主导地位的时代里，中国经济显示出明显规律性的库存周期，近年来已不明显，短期疫情对经济走势形成明显扰动，中长期看，库存周期可能会随着经济结构的调整而逐渐弱化。疫情前后较为克制的货币政策使用将为未来预留空间，但较高的宏观杠杆率和仍未完成的金融供给侧改革将对政策发力形成制约。在国际政治经济领域的博弈中，我们具有全球最大的消费市场、容量最大且最完备的工业体系，虽然未来可能会不时地面临贸易纠纷、技术封锁甚至金融封锁的不利局面，我们在国际社会中的比较优势大概率仍会不断累积。此外，国内改革红利的释放进程和改革效果更值得关注。中长期来看，经济增长中枢缓慢下行的趋势可能还会持续较长时间，人口老龄化、消费升级、创新驱动、行业集中度提升等趋势确定性较强，我们更多将着眼于这些变量捕捉投资机会。

中期来看，经济缓慢下行且节奏可控，旧经济领域资本开支增速总体将变慢，新经济值得期待但已经出现局部估值泡沫。与经济增速密切相关的强周期品种，估值水平难以明显提升。在当前时点，供需格局良好、竞争格局改善的行业和其中的龙头标的，在估值相对合理的情况下，值得重点布局。

信用债市场的信用状况可能会随着疫情的进展而呈现阶段性波动，但违约常态化状况可能会维持。2019 年违约家数和金额均明显超过去年同期。多数债务融资需求较大的传统行业均出现了集中度提升趋势，从实体经济、间接融资的信贷市场和直接融资的债券市场映射到资本市场，股票分层的趋势虽有阶段缓和但难以逆转。存量经济中，龙头企业的成本优势、品牌溢价、产品力溢价均会被放大，导致弱肉强食的局面持续发生；新经济中少数能够创造需求、引领需求的企业有望持续享受估值溢价。以新经济名义吸引投资者眼球的企业将会逐渐被市场证伪继而被边缘化。

在经济下行、有效融资需求下降的背景下，债券收益率上行空间有限，二季度以来的市场调整使得债券市场的吸引力在慢慢增强。在宏观经济从稳态到激发态再到新稳态的过程中，我们更注重业绩及业绩增速的内生稳定性和可持续性，关注新经济中符合消费升级与技术创新方向、具有较高确定性的行业和标的。我们也持续关注旧经济领域集中度提升和估值吸引力显现带来的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、估值工作小组的职责分工

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

估值工作小组职责：

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

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

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

二、基金会计的职责分工

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

基金会计职责：

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

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部门的职责分工

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

四、交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；

- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

五、监察稽核部的职责分工

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期共进行了 4 次分红，2020 年 1 月 7 日第一次分红，每 10 份派发 0.625 元，分配红利总金额 5,737,009.29 元；2020 年 2 月 4 日第二次分红，每 10 份派发 0.328，分配红利总金额 3,044,215.20 元；2020 年 3 月 13 日第 3 次分红，每 10 份派发 0.409 元，分配红利总金额 3,0244,09.29 元；2020 年 6 月 18 日第 4 次分红；每 10 份派发 1.000 元，分配红利总金额 4,821,157.92 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金从 2020 年 3 月 20 日起至 2020 年 6 月 12 日连续五十七个工作日基金资产净值低于伍仟万元。

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

本报告期内，本基金托管人在对新华红利回报混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，新华红利回报混合型证券投资基金的管理人——新华基金管理股份有限公司在新华红利回报混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新华红利回报混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 4

次利润分配，分配金额为 16,626,791.70 元。

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

本托管人依法对新华基金管理股份有限公司编制和披露的新华红利回报混合型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2020 年 7 月 24 日

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：新华红利回报混合型证券投资基金

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
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	436,721.87	1,337,693.79
结算备付金		277,266.81	285,094.81
存出保证金		21,787.19	25,715.23
交易性金融资产	6.4.7.2	45,197,519.33	106,103,658.66
其中：股票投资		20,013,331.47	87,426,096.66
基金投资		-	-
债券投资		25,184,187.86	18,677,562.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	7,500,000.00	3,300,000.00
应收证券清算款		1,703,582.69	616,282.23
应收利息	6.4.7.4	260,251.55	522,354.75
应收股利		-	-
应收申购款		202,694.05	38,300.64
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		55,599,823.49	112,229,100.11

负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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		719,150.06	440,934.01
应付赎回款		1,132,192.96	110,990.72
应付管理人报酬		57,232.86	138,681.64
应付托管费		9,538.78	23,113.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.5	87,406.22	66,525.71
应交税费		1,132.63	869.12
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	100,038.44	130,064.04
负债合计		2,106,691.95	911,178.86
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.7	48,136,074.82	91,975,085.39
未分配利润	6.4.7.8	5,357,056.72	19,342,835.86
所有者权益合计		53,493,131.54	111,317,921.25
负债和所有者权益总计		55,599,823.49	112,229,100.11

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1113 元，基金份额 48,136,074.82 份。

6.2 利润表

会计主体：新华红利回报混合型证券投资基金

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
一、收入		5,874,322.87	12,419,057.18
1.利息收入		341,902.01	528,310.69
其中：存款利息收入	6.4.7.9	9,201.11	9,242.24
债券利息收入		286,437.25	509,798.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		46,263.65	9,270.11
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,639,105.52	2,120,337.06

其中：股票投资收益	6.4.7.10	15,232,166.17	1,980,431.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	385,315.21	-249,278.19
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	21,624.14	389,183.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-10,264,307.68	9,661,451.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	157,623.02	108,957.94
减：二、费用		920,103.69	665,888.06
1. 管理人报酬		505,229.33	352,864.12
2. 托管费		84,204.86	58,810.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.15	209,194.20	117,235.37
5. 利息支出		315.39	39,434.75
其中：卖出回购金融资产支出		315.39	39,434.75
6.税金及附加		658.21	1,587.97
7. 其他费用	6.4.7.16	120,501.70	95,955.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,954,219.18	11,753,169.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,954,219.18	11,753,169.12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华红利回报混合型证券投资基金

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）	91,975,085.39	19,342,835.86	111,317,921.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,954,219.18	4,954,219.18
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）	-43,839,010.57	-2,313,206.62	-46,152,217.19
其中：1.基金申购款	44,447,769.37	7,253,686.64	51,701,456.01
2.基金赎回款	-88,286,779.94	-9,566,893.26	-97,853,673.20

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）	-	-16,626,791.70	-16,626,791.70
五、期末所有者权益（基金净值）	48,136,074.82	5,357,056.72	53,493,131.54
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）	46,484,458.80	-799,048.23	45,685,410.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,753,169.12	11,753,169.12
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）	33,652,889.02	4,028,959.02	37,681,848.04
其中：1.基金申购款	70,724,192.03	8,399,006.18	79,123,198.21
2.基金赎回款	-37,071,303.01	-4,370,047.16	-41,441,350.17
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）	80,137,347.82	14,983,079.91	95,120,427.73

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

新华红利回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1483 号文件“关于准予新华红利回报混合型证券投资基金注册的批复”，由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于 2016 年 12 月 30 日至 2017 年 3 月 21 日向社会公开募集，首次募集资金总额 272,798,500.29 元，其中募集资金产生利息 31,490.33 元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2017]01360012 号验资报告予以验证。2017 年 3 月 27 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不限定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金及到期日在一年以内的政府债券,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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:股票投资占基金资产的比例为 0-80%,权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%,每个交易日日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

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,按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则——基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的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》、《新华红利回报混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与上年度一致,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

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税法征收方式，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	436,721.87
定期存款	-
其他存款	-
合计	436,721.87

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	15,708,517.55	20,013,331.47	4,304,813.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	19,764,656.92	19,715,185.16
	银行间市场	5,542,187.93	5,469,002.70
	合计	25,306,844.85	25,184,187.86
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	41,015,362.40	45,197,519.33	4,182,156.93

6.4.7.3 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末

	2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
上交所市场	7,500,000.00	-
合计	7,500,000.00	-

6.4.7.4 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	66.69
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	121.23
应收债券利息	260,063.63
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	260,251.55

注：结算备付金利息包含存出保证金利息。

6.4.7.5 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	87,096.22
银行间市场应付交易费用	310.00
合计	87,406.22

6.4.7.6 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	584.54
应付证券出借违约金	-

其他应付款	-
预提费用	99,453.90
合计	100,038.44

6.4.7.7 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	91,975,085.39	91,975,085.39
本期申购	44,447,769.37	44,447,769.37
本期赎回（以“-”号填列）	-88,286,779.94	-88,286,779.94
本期末	48,136,074.82	48,136,074.82

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	6,055,686.17	13,287,149.69	19,342,835.86
本期利润	15,218,526.86	-10,264,307.68	4,954,219.18
本期基金份额交易产生的变动数	561,027.40	-2,874,234.02	-2,313,206.62
其中：基金申购款	5,375,949.07	1,877,737.57	7,253,686.64
基金赎回款	-4,814,921.67	-4,751,971.59	-9,566,893.26
本期已分配利润	-16,626,791.70	-	-16,626,791.70
本期末	5,208,448.73	148,607.99	5,357,056.72

6.4.7.9 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	6,274.43
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	2,926.68	
其他	-	
合计	9,201.11	

注：结算备付金利息包含存出保证金利息。

6.4.7.10 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	96,310,866.35
减：卖出股票成本总额	81,078,700.18
买卖股票差价收入	15,232,166.17

6.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,023,938.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,398,584.46
减：应收利息总额	240,038.38
买卖债券差价收入	385,315.21

6.4.7.12 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	21,624.14
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	21,624.14

6.4.7.13 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	-10,264,307.68
——股票投资	-9,852,954.59
——债券投资	-411,353.09
——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	-10,264,307.68

6.4.7.14 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	156,643.24
转换费收入	979.78
合计	157,623.02

6.4.7.15 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	208,404.20
银行间市场交易费用	790.00
合计	209,194.20

6.4.7.16 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	59,672.34
证券出借违约金	-
债券账户维护费	18,000.00
汇划手续费	2,447.80
其他	600.00
合计	120,501.70

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

截至本报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 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	12,379,196.90	11.06%	954,503.00	0.92%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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

本基金本报告期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

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	21,100,000.00	4.82%	400,000.00	0.14%

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	9,053.01	9.43%	9,053.01	10.39%
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	698.04	0.87%	698.04	0.92%

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监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	505,229.33	352,864.12
其中：支付销售机构的客户维护费	127,610.79	121,420.07

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	84,204.86	58,810.79

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提确认。

其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 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，均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

报告期内无转融通出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

报告期内无转融通出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 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
中国工商银行股份有限公司	436,721.87	6,274.43	3,258,091.64	7,199.04

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020-01-07	2020-01-07	2020-01-07	0.625	796,156.42	4,940,852.87	5,737,009.29	-
2	2020-02-04	2020-02-04	2020-02-04	0.328	382,631.86	2,661,583.34	3,044,215.20	-
3	2020-03-13	2020-03-13	2020-03-13	0.409	530,738.55	2,493,670.74	3,024,409.29	-
4	2020-06-18	2020-06-18	2020-06-18	1.000	3,267,521.20	1,553,636.72	4,821,157.92	-
合计				2.362	4,977,048.03	11,649,743.67	16,626,791.70	-

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
601816	京沪高铁	2020-01-08	2020-07-16	新股锁定期内	4.88	6.17	906,536.00	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688169	石头科技	2020-02-13	2020-08-21	新股锁定期内	271.12	365.14	717.00	194,393.04	261,805.38	-
688090	瑞松科技	2020-02-07	2020-08-17	新股锁定期内	27.55	59.45	2,058.00	56,697.90	122,348.10	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金未参与转融通证券出借业务。

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。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年末

	2020年6月30日	2019年12月31日
AAA	19,552,711.80	15,616,562.00
AAA 以下	3,680,423.36	3,061,000.00
未评级	1,951,052.70	-
合计	25,184,187.86	18,677,562.00

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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	436,721.87	-	-	-	436,721.87
结算备付金	277,266.81	-	-	-	277,266.81
存出保证金	21,787.19	-	-	-	21,787.19
交易性金融资产	9,954,076.06	15,230,111.80	-	20,013,331.47	45,197,519.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	7,500,000.00	-	-	-	7,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,703,582.69	1,703,582.69
应收利息	-	-	-	260,251.55	260,251.55
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	202,694.05	202,694.05
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,189,851.93	15,230,111.80	-	22,179,859.76	55,599,823.49
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	-	-	-	719,150.06	719,150.06
应付赎回款	-	-	-	1,132,192.96	1,132,192.96
应付管理人报酬	-	-	-	57,232.86	57,232.86
应付托管费	-	-	-	9,538.78	9,538.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	87,406.22	87,406.22
应交税费	-	-	-	1,132.63	1,132.63
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	100,038.44	100,038.44
负债总计	-	-	-	2,106,691.95	2,106,691.95
利率敏感度缺口	18,189,851.93	15,230,111.80	-	20,073,167.81	53,493,131.54
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	1,337,693.79	-	-	-	1,337,693.79
结算备付金	285,094.81	-	-	-	285,094.81
存出保证金	25,715.23	-	-	-	25,715.23
交易性金融资产	6,387,622.00	6,870,940.00	5,419,000.00	87,426,096.66	106,103,658.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,300,000.00	-	-	-	3,300,000.00
应收证券清算款	-	-	-	616,282.23	616,282.23
应收利息	-	-	-	522,354.75	522,354.75
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	38,300.64	38,300.64
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,336,125.83	6,870,940.00	5,419,000.00	88,603,034.28	112,229,100.11
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	-	-	-	440,934.01	440,934.01
应付赎回款	-	-	-	110,990.72	110,990.72
应付管理人报酬	-	-	-	138,681.64	138,681.64
应付托管费	-	-	-	23,113.62	23,113.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	66,525.71	66,525.71
应交税费	-	-	-	869.12	869.12
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	130,064.04	130,064.04
负债总计	-	-	-	911,178.86	911,178.86
利率敏感度缺口	11,336,125.83	6,870,940.00	5,419,000.00	87,691,855.42	111,317,921.25

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	-105,607.98	-118,237.19
	市场利率下降 25.00 bp	106,629.35	120,369.24

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的资产与负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2020 年 6 月 30 日		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	20,013,331.47	37.41	87,426,096.66	78.54
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	25,184,187.86	47.08	18,677,562.00	16.78
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	45,197,519.33	84.49	106,103,658.6	95.32

			6	
--	--	--	---	--

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%	191,716.12	827,707.62
	沪深 300 指数下降 1%	-191,716.12	-827,707.62

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	20,013,331.47	36.00
	其中: 股票	20,013,331.47	36.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,184,187.86	45.30
	其中: 债券	25,184,187.86	45.30
	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	7,500,000.00	13.49
	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	713,988.68	1.28
8	其他各项资产	2,188,315.48	3.94
9	合计	55,599,823.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,503,989.48	19.64
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	5,593,327.12	10.46
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	-	-
K	房地产业	1,512,096.00	2.83
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,733,776.80	3.24
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	670,142.07	1.25
S	综合	-	-
	合计	20,013,331.47	37.41

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	10.46
2	603259	药明康德	17,948	1,733,776.80	3.24
3	600690	海尔智家	97,000	1,716,900.00	3.21
4	600276	恒瑞医药	18,072	1,668,045.60	3.12
5	000651	格力电器	22,600	1,278,482.00	2.39
6	000999	华润三九	40,000	1,167,600.00	2.18
7	001979	招商蛇口	50,000	822,000.00	1.54

8	600809	山西汾酒	5,500	797,500.00	1.49
9	600887	伊利股份	24,800	772,024.00	1.44
10	600872	中炬高新	12,600	737,478.00	1.38
11	600519	贵州茅台	500	731,440.00	1.37
12	000002	万科A	26,400	690,096.00	1.29
13	600977	中国电影	51,039	670,142.07	1.25
14	000860	顺鑫农业	11,100	632,478.00	1.18
15	600750	江中药业	40,000	505,600.00	0.95
16	688169	石头科技	717	261,805.38	0.49
17	688090	瑞松科技	2,058	122,348.10	0.23
18	603180	金牌厨柜	2,380	112,288.40	0.21

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	601816	京沪高铁	6,319,848.88	5.68
2	603180	金牌厨柜	2,269,386.00	2.04
3	000860	顺鑫农业	2,248,698.00	2.02
4	300003	乐普医疗	1,636,832.00	1.47
5	600009	上海机场	1,279,835.00	1.15
6	000999	华润三九	1,094,372.00	0.98
7	601318	中国平安	1,013,667.00	0.91
8	000002	万科A	937,600.00	0.84
9	600519	贵州茅台	900,027.00	0.81
10	001979	招商蛇口	821,500.00	0.74
11	600872	中炬高新	761,000.00	0.68
12	603027	千禾味业	726,939.00	0.65
13	600036	招商银行	696,800.00	0.63
14	600750	江中药业	456,400.00	0.41
15	600276	恒瑞医药	420,200.00	0.38
16	603259	药明康德	364,080.00	0.33
17	688169	石头科技	194,393.04	0.17
18	688158	优刻得	122,286.40	0.11
19	688396	华润微	112,704.00	0.10
20	688200	华峰测控	90,224.40	0.08

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（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	601318	中国平安	4,568,182.00	4.10
2	688111	金山办公	3,902,067.21	3.51
3	600036	招商银行	3,784,358.05	3.40
4	300413	芒果超媒	3,576,018.00	3.21
5	600031	三一重工	3,551,352.00	3.19
6	600519	贵州茅台	3,536,535.00	3.18
7	000333	美的集团	3,095,485.00	2.78
8	600585	海螺水泥	2,993,373.49	2.69
9	600887	伊利股份	2,848,547.00	2.56
10	600009	上海机场	2,777,585.00	2.50
11	601816	京沪高铁	2,666,327.75	2.40
12	600809	山西汾酒	2,604,236.00	2.34
13	002568	百润股份	2,538,111.00	2.28
14	600196	复星医药	2,512,893.00	2.26
15	600132	重庆啤酒	2,442,892.00	2.19
16	601966	玲珑轮胎	2,433,785.00	2.19
17	600276	恒瑞医药	2,308,503.00	2.07
18	600600	青岛啤酒	2,295,089.00	2.06
19	603259	药明康德	2,089,440.00	1.88
20	603180	金牌厨柜	1,964,363.00	1.76

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	23,518,889.58
卖出股票的收入（成交）总额	96,310,866.35

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，不考虑相关费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	500,250.00	0.94
2	央行票据	-	-

3	金融债券	3,476,602.70	6.50
	其中：政策性金融债	1,450,802.70	2.71
4	企业债券	3,256,100.00	6.09
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,992,400.00	3.72
7	可转债（可交换债）	15,958,835.16	29.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,184,187.86	47.08

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132015	18 中油 EB	53,000	5,300,000.00	9.91
2	132013	17 宝武 EB	50,000	5,111,500.00	9.56
3	091900026	19 中国华融债 01	20,000	2,025,800.00	3.79
4	124938	PR 郴百福	50,000	2,022,500.00	3.78
5	102000239	20 南航股 MTN004	20,000	1,992,400.00	3.72

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金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 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.13.3 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	21,787.19
2	应收证券清算款	1,703,582.69
3	应收股利	-
4	应收利息	260,251.55
5	应收申购款	202,694.05

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,188,315.48

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	1,315,111.80	2.46
2	110057	现代转债	996,570.00	1.86
3	113021	中信转债	942,210.00	1.76
4	110053	苏银转债	635,520.00	1.19

7.13.5 期末前十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	601816	京沪高铁	5,593,327.12	10.46	锁定期股票

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

1,499	32,112.12	5,807,781.77	12.07%	42,328,293.05	87.93%
-------	-----------	--------------	--------	---------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年3月27日）基金份额总额	272,798,500.29
本报告期期初基金份额总额	91,975,085.39
本报告期基金总申购份额	44,447,769.37
减：本报告期基金总赎回份额	88,286,779.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	48,136,074.82

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。本报告期本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

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	44,321,456.68	39.59%	41,276.29	43.00%	-
中信证券	3	27,003,620.10	24.12%	19,791.31	20.62%	-
恒泰证券	2	12,379,196.90	11.06%	9,053.01	9.43%	-
长江证券	3	10,544,901.46	9.42%	9,796.78	10.21%	-
海通证券	1	6,841,294.37	6.11%	6,371.27	6.64%	-
招商证券	1	5,975,915.60	5.34%	5,565.26	5.80%	-
安信证券	1	2,841,780.99	2.54%	2,646.57	2.76%	-
天风证券	4	1,931,861.25	1.73%	1,412.81	1.47%	-
中信建投证券	2	98,175.00	0.09%	71.80	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32个交易席位,其中报告期内新增1个交易席位,退租0个交易席位。其中新增席位为:天风证券上海席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础,主要考察点包括:

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

二、交易席位的选择流程

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

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础,主要考察点包括:

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

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

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

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	719,121.23	3.53%	-	-	-	-

国信证券	1,669,800.00	8.19%	173,100,000.00	39.54%	-	-
中信证券	14,742,483.47	72.31%	163,300,000.00	37.30%	-	-
恒泰证券	-	-	21,100,000.00	4.82%	-	-
长江证券	-	-	5,000,000.00	1.14%	-	-
海通证券	2,405,990.00	11.80%	69,200,000.00	15.81%	-	-
安信证券	850,260.00	4.17%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	6,100,000.00	1.39%	-	-

注：回购交易不包含非担保交收金额。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华基金管理股份有限公司关于新华红利回报混合型证券投资基金暂停大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-01-02
2	新华红利回报混合型证券投资基金基金分红公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-01-06
3	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	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	2020-01-10
4	关于新华红利回报混合型证券投资基金恢复大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-01-11
5	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年第 4 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	2020-01-20
6	新华红利回报混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-01-20
7	新华基金管理股份有限公司关于新华红利回报混合型证券投资基金暂停大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-01-23
8	新华红利回报混合型证券投资基金基金分红公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-02-03
9	关于新华红利回报混合型证券投资基金恢复大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-02-08
10	关于新华红利回报混合型证券投资基金暂停大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-03-11

11	新华红利回报混合型证券投资基金基金分红公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-03-12
12	新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加上海好买基金销售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	2020-03-17
13	关于新华红利回报混合型证券投资基金恢复大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-03-19
14	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
15	新华红利回报混合型证券投资基金 2019 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2020-03-26
16	新华基金管理股份有限公司关于董事及独立董事变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-03-27
17	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
18	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
19	新华红利回报混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-04-21
20	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
21	新华红利回报混合型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	2020-05-09
22	新华红利回报混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-05-09
23	新华基金管理股份有限公司新华红利回报混合型证券投资基金增加中泰证券股份有限公司、大同证券有限责任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	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-05-30
24	新华基金管理股份有限公司新华红利回报混合型证券投资基金增加光大证券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	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-06-04
25	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金增加安信证券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	2020-06-06
26	新华基金管理股份有限公司关于新华红利回	上海证券报、公司网站、	2020-06-06

	报混合型证券投资基金参加中泰证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	电子信披网站	
27	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
28	新华基金管理股份有限公司新华红利回报混合型证券投资基金增加中国银河证券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	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-06-09
29	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
30	新华基金管理股份有限公司关于新华红利回报混合型证券投资基金恢复大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-06-23
31	新华基金管理股份有限公司关于新华红利回报混合型证券投资基金增加长江证券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	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-06-30
32	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 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200310-20200316	15,358,081.01	0.00	15,358,081.01	0.00	0.00%
	2	20200310-20200316	14,743,278.40	0.00	14,743,278.40	0.00	0.00%
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>							

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华红利回报混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华红利回报混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华红利回报混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华红利回报混合型证券投资基金基金合同
- (五) 新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六) 更新的《新华红利回报混合型证券投资基金招募说明书》
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (九) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

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

新华基金管理股份有限公司

二〇二〇年八月二十七日