

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)
2020 年年度报告
2020 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：二〇二一年三月三十日

§ 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 2021 年 3 月 29 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。

本报告中财务资料已经审计。致同会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 4 月 26 日起至 12 月 31 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	8
2.1 基金基本情况.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	10
3.2 基金净值表现.....	10
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.....	10
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验.....	12
4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.3.1 公平交易制度和控制方法.....	14
4.3.2 公平交易制度的执行情况.....	14
4.3.3 异常交易行为的专项说明.....	14
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.....	15
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析.....	15
4.4.2 报告期内基金的业绩表现.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
§6 审计报告	18
6.1 审计意见.....	19
6.2 形成审计意见的基础.....	19
6.3 其他信息.....	19
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	19
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	20
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
7.4.1 基金基本情况.....	24
7.4.2 会计报表的编制基础.....	25
7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明.....	25
7.4.4 重要会计政策和会计估计.....	25
7.4.4.1 会计年度.....	25

7.4.4.2 记账本位币	25
7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类	25
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	26
7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则	26
7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销	27
7.4.4.7 实收基金	27
7.4.4.8 损益平准金	27
7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量	27
7.4.4.10 费用的确认和计量	28
7.4.4.11 基金的收益分配政策	28
7.4.4.12 外币交易	28
7.4.4.13 分部报告	28
7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计	28
7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明	30
7.4.5.1 会计政策变更的说明	30
7.4.5.2 会计估计变更的说明	30
7.4.5.3 差错更正的说明	30
7.4.6 税项	30
7.4.7.2 交易性金融资产	31
7.4.7.3 衍生金融资产/负债	32
7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券	32
7.4.7.7 应付交易费用	33
7.4.7.8 其他负债	33
7.4.7.9 实收基金	33
7.4.7.10 未分配利润	34
7.4.7.11 存款利息收入	34
7.4.7.12 股票投资收益	34
7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成	34
7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入	34
7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入	35
7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入	35
7.4.7.13 基金投资收益	35
7.4.7.14 债券投资收益	35
7.4.7.15 资产支持证券投资收益	36
7.4.7.16 贵金属投资收益	36
7.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成	36
7.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入	36
7.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入	36
7.4.7.17 衍生工具收益	36
7.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益	36
7.4.7.18 股利收益	36
7.4.7.20 其他收入	37
7.4.7.22 其他费用	38
7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明	39
7.4.8.1 或有事项	39

7.4.8.2 资产负债表日后事项	39
7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易	39
7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易	39
7.4.10.1.1 股票交易	39
7.4.10.1.2 权证交易	39
7.4.10.1.3 债券交易	40
7.4.10.1.4 债券回购交易	40
7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金	40
7.4.10.2 关联方报酬	40
7.4.10.2.1 基金管理费	40
7.4.10.2.2 基金托管费	40
7.4.10.2.3 销售服务费	41
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	41
7.4.10.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入	41
7.4.11 利润分配情况	42
7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券	42
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	42
7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票	42
7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券	42
7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购	42
7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购	42
7.4.13 金融工具风险及管理	42
7.4.13.1 风险管理政策和组织架构	42
7.4.13.2 信用风险	42
7.4.13.3 流动性风险	43
7.4.13.4 市场风险	43
7.4.13.4.1 利率风险	43
7.4.13.4.1.1 利率风险敞口	44
7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析	45
7.4.13.4.2 外汇风险	45
7.4.13.4.3 其他价格风险	45
7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口	45
7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析	46
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细	47
8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细	47
8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47

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	47
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细	48
8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策	48
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
8.11.1 本期国债期货投资政策	48
8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细	48
8.12 本报告期投资基金情况	48
8.13 投资组合报告附注	51
8.13.3 期末其他各项资产构成	51
8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细	51
8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明	51
§9 基金份额持有人信息	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
9.3 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	52
§10 开放式基金份额变动	52
§11 重大事件揭示	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	53
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	54
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.9 其他重大事件	56
12 影响投资者决策的其他重要信息	58
§13 备查文件目录	58
13.1 备查文件目录	58
13.2 存放地点	59
13.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)
基金简称	新华精选成长主题 3 个月持有期混合(FOF)
基金主代码	009146
交易代码	009146
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 26 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	63,320,677.50 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将精选具有成长风格的金牛基金以及其他优质基金构建投资组合，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金投资策略包括资产配置策略、基金投资策略、债权投资策略。</p> <p>本基金运用定量与定性相结合的研究方法进行基金精选，对国内公开募集的开放式证券投资基金的业绩、风险、持仓、规模、持有人结构和费率等要素进行定量分析，对拟投资的基金投资策略、决策流程、风险措施、基金经理、投资团队、研究支持和公司管理等要素进行定量及定性分析，自下而上精选出投资能力稳健、持续业绩良好、投资风格稳定的基金。</p> <p>基金管理人将同时入选金牛成长核心基金池和重点投资基金池的优质基金组成“精选成长组合”。本基金以“精选成长组合”为投资重点，辅以全市场精选出的优质基金构建投资组合，在保持适度流动性、控制风险的前提下增厚组合收益。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于货币市场基金、货币型基金

	中基金、债券型基金和债券型基金中基金。
--	---------------------

注：《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并 6 个月内召集基金份额持有人大会。

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	秦一楠
	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,北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座	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		张宗友	周慕冰

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	致同会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 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	2020 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	30,082,400.83
本期利润	37,758,579.84
加权平均基金份额本期利润	0.3205
本期加权平均净值利润率	29.56%
本期基金份额净值增长率	26.25%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	16,622,358.10
期末可供分配基金份额利润	0.2625
期末基金资产净值	79,943,035.60
期末基金份额净值	1.2625
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	26.25%

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；由于本基金采用摊余成本法核算，所以公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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、本基金合同于 2020 年 4 月 26 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

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	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	10.10%	0.93%	2.31%	0.69%	7.79%	0.24%
过去六个月	18.87%	1.03%	5.62%	0.86%	13.25%	0.17%
自基金合同 生效起至今	26.25%	0.93%	11.80%	0.80%	14.45%	0.13%

注：1.本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%；

2.本基金合同生效日为 2020 年 04 月 26 日，截至本报告期末未满一年。

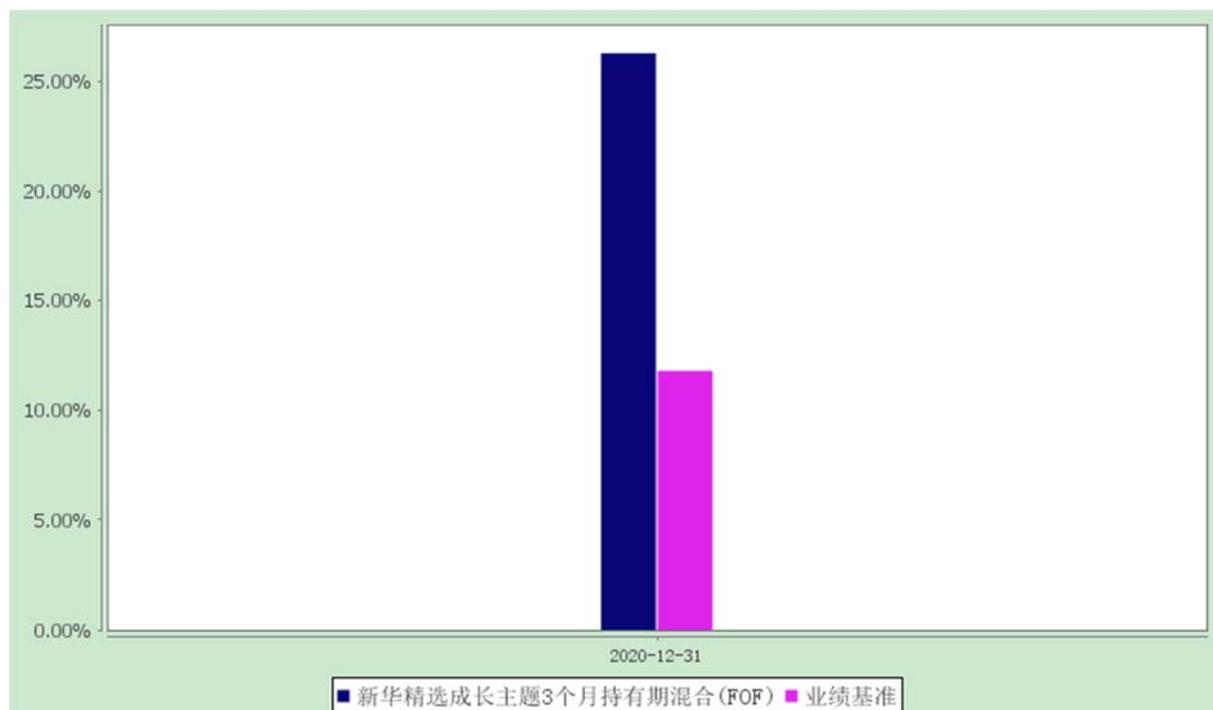
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于 2020 年 04 月 26 日生效，截至 2020 年 12 月 31 日基金成立未满一年；

2、自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

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



注：本基金于 2020 年 4 月 26 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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至 2020 年 12 月 31 日未进行利润分配。

§ 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 2020 年 12 月 31 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十九只开放式基金，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、新华恒稳添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、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）、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金。

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		
王奕蕾	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司基金投资部总监。	2020-04-26	-	8	金融学硕士，历任方正证券股份有限公司研究所研究员，先后担任固定收益分析师和基金分析师,新华基金投资经理。
李强	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司产品开发部总监。	2020-04-26	-	13	投资分析硕士，历任大成基金管理有限公司产品设计师、工银瑞信基金管理有限公司产品经理、国泰基金管理有限公司高级产品经理，负责国内外基金行业的研究、公募基金产品以及特定客户资产管理计划的研究、设计和开发。

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

注：本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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 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。

基金管理人对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

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，全球资本市场在疫情等因素影响之下经历剧烈震荡，3 月份以来，随着疫情全球蔓延叠加石油价格战的影响，全球股市急速下跌，美股更是出现史无前例的四次熔断，流动性问题凸显，股、债、黄金、虚拟货币等各类资产均遭到无差别打击。随着各项防疫措施的出台以及全球的流动性宽松，复工复产有序推进，随着经济基本面的修复，权益资产大幅上涨，9 月以来，流动性边际收紧、中美摩擦持续升温、全球疫情出现二次反复等内外部利空因素叠加使得 A 股转入低迷期，资金开始流入确定性较强的板块，如顺周期、消费、新能源等。纵观全年，在流动性较充裕、同时“炒房”热被有效抑制的情况下，权益市场的吸引力大幅提升，但同时板块轮动效应也比较明显，市场以结构性行情为主，核心资产及部分成长股估值抬升幅度较大。债券市场波动同样比较大，疫情引发资金风险偏好下行，叠加宽松的货币政策，债券收益率持续下行。而 5 月份以来，在经济超预期恢复、流动性边际转紧以及债券供给增加等多重不利因素的影响之下，债券市场结束了两年多的牛市转而进入低迷期。而在债市逐渐恢复元气的过程中，“永煤”等国企违约事件引发信用市场出现较大幅度的波动，

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.2625 元，本报告期份额净值增长率为 26.25%，同期比较基准的增长率为 11.80%。

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 2021 年，中国经济恢复最快的阶段已然过去，随着经济的持续向上，政策上的托底诉求下降，货币政策将边际收紧。相比 2020 年，2021 年市场将更加难以操作，同时，从股债的相对性价比来说，股票性价比降低，对于权益资产的预期收益也有所下降，呈现结构分化的状态。

权益市场方面，我们看到 2019 年开启的科技、消费、医药的结构性牛市使得不同板块间的估值差异较大，市场分化较为显著，部分板块估值高企。从 2020 年下半年开始，市场逐步进入风格切换的过程中，推动股价的基本驱动力从上半年的流动性驱动，转向了下半年的盈利驱动。在这样的市场环境之下，基本面趋势较强行业中估值优势相对明显的顺周期成长板块在近期也得到了估值修复。伴随着社融增速的见顶回落，预期经济和企业盈利也将在 1 季度达到高点。近期由于美国 10 年期国债收益率不断上升，引发市场对于通胀的预期急速攀升，进而担心流动性收紧的预期也急剧升温，引得全球资本市场共震，同时由于节前涨幅过高导致部分行业和股票估值偏高，存在调整压力，春节后市场大幅下跌，我们认为市场并不会就此转向熊市，依然存在结构性的机会。在这样的市场环境下，风格上应该更加均衡，包括继续持有高端制造、汽车、机械、化工等顺周期板块，同时也要紧抓政策上进一步得到确认的科技主线，同时关注碳中和主题投资机会，积极寻找相关标的。

在操作上，我们对组合进行了一定的结构调整，适当坚持了一些估值过高的板块，增配了一些

标的池中偏向顺周期方向以及偏低估值的金融板块的基金产品进行分散投资，市场宽幅震荡的过程中，从控制风险的角度，我们不会主动增加仓位，会将组合的风险控制提到第一位。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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，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。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效,截至 2020 年 12 月 31 日成立未满一年,本报告期内,本基金未进行利润分配。

§ 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《中华人民共和国证券投资基金法》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 2020 年 04 月 26 日至 2020 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《中华人民共和国证券投资基金法》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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

致同审字(2021)第 110A005975 号

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)全体基金份额持有人:

我们审计了新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、2020 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日的利润表、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”）发布的有关规定编制，公允反映了新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日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，我们独立于新华精选成长 3 个月混合（FOF）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

新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金的基金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。其他信息包括新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金 2020 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 管理层和治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新华精选成长 3 个月混合（FOF）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新华精选成长 3 个月混合（FOF）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新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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，根据所获取的审计证据，就可能对新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金的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新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金不能持续经营。

(5) 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。

致同会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

范晓红 刘蕾

北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层

2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末
----	-----	-----

		2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	6,483,674.26
结算备付金		17,998.13
存出保证金		5,719.59
交易性金融资产	7.4.7.2	73,690,109.05
其中：股票投资		-
基金投资		73,690,109.05
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		-
应收利息	7.4.7.5	1,359.83
应收股利		-
应收申购款		414,035.67
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		80,612,896.53
负债和所有者权益		本期末
		2020 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		-
应付赎回款		443,791.61
应付管理人报酬		52,706.64
应付托管费		10,966.28
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	-
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	162,396.40
负债合计		669,860.93
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	63,320,677.50
未分配利润	7.4.7.10	16,622,358.10
所有者权益合计		79,943,035.60
负债和所有者权益总计		80,612,896.53

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。截至 2020 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.2625 元，基金份额为 63,320,677.50 份。

7.2 利润表

会计主体：新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2020 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2020 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		39,584,181.32
1.利息收入		53,101.77
其中：存款利息收入	7.4.7.11	53,101.77
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		31,245,629.71
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	7.4.7.13	29,813,962.81
债券投资收益	7.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.15	-
贵金属投资收益	7.4.7.16	-
衍生工具收益	7.4.7.17	-

股利收益	7.4.7.18	1,431,666.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	7,676,179.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	609,270.83
减：二、费用		1,825,601.48
1. 管理人报酬		814,842.43
2. 托管费		149,959.76
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.21	683,765.23
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		8,946.45
7. 其他费用	7.4.7.22	168,087.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,758,579.84
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,758,579.84

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2020 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 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）	222,428,427.57	-	222,428,427.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,758,579.84	37,758,579.84
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	-159,107,750.07	-21,136,221.74	-180,243,971.81

列)			
其中：1.基金申购款	39,015,879.09	7,299,672.44	46,315,551.53
2.基金赎回款	-198,123,629.16	-28,435,894.18	-226,559,523.34
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）	63,320,677.50	16,622,358.10	79,943,035.60

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。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：翟晨曦，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

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)(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[2020]279 号文件《关于准予新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》核准，由新华基金管理股份有限公司于 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 4 月 21 日向社会公开募集，首次募集资金总额 222,428,427.57 元，其中募集资金产生利息 83,535.76 元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2020]36010005 号验资报告予以验证。2020 年 4 月 26 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型定期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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》及《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的证券投资基金、国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具（含同业存单）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资于 QDII 基金、香港互认基金，也不投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金。本基金不直接在二级市场买入股票，也不参与一级市场新股申购和新股增发。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：本基金投资于经中国证监会核准或注册的基金份额占基金资产的比例不低于 80%，股票型基金的投资占基金资产的比例为 10%-50%，投资于“精选成长组合”成份基金的比例不低于非现金基金资产的 80%。现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，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。

本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金。

本基金业绩比较基准：中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

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 2021 年 3 月 29 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，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 4 月 26 日(基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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。本期财务报表的实际编制期间为自 2020 年 4 月 26 日(基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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。

本基金以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

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

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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，基金管理人不可

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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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损益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。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按

直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法

逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期间无外币交易。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、基金投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数

收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》，按采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；

(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 2 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	
	2020 年 12 月 31 日	
活期存款	6,483,674.26	
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	6,483,674.26	

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	66,013,930.04	73,690,109.05	7,676,179.01

其他	-	-	-
合计	66,013,930.04	73,690,109.05	7,676,179.01

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

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

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,349.13
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	10.70
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	1,359.83

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	429.19
其他应付款	-
预提费用	161,967.21
合计	162,396.40

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	222,428,427.57	222,428,427.57
本期申购	39,015,879.09	39,015,879.09
本期赎回（以“-”号填列）	-198,123,629.16	-198,123,629.16
本期末	63,320,677.50	63,320,677.50

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	30,082,400.83	7,676,179.01	37,758,579.84
本期基金份额交易产生的变动数	-3,097,602.93	-18,038,618.81	-21,136,221.74
其中：基金申购款	15,396,369.77	-8,096,697.33	7,299,672.44
基金赎回款	-18,493,972.70	-9,941,921.48	-28,435,894.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,984,797.90	-10,362,439.80	16,622,358.10

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	52,865.97
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	235.80
其他	0.00
合计	53,101.77

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

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**

截至本报告期末，本基金无股票投资收益。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

截至本报告期末，本基金无股票投资收益——买卖股票差价收入。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合

同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

截至本报告期末，本基金无股票投资收益—赎回差价收入。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

截至本报告期末，本基金无股票投资收益—申购差价收入。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	328,164,516.00
减：卖出/赎回基金成本总额	298,350,553.19
基金投资收益	29,813,962.81

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

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

截至本报告期末，本基金无债券投资收益。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

截至本报告期末，本基金无债券投资收益—买卖债券差价收入。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

截至本报告期末，本基金无债券投资收益—赎回差价收入。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

截至本报告期末，本基金无债券投资收益—申购差价收入。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

截至本报告期末，本基金无资产支持证券投资收益。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.16 贵金属投资收益**7.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成**

截至本报告期末，本基金无贵金属投资收益。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

截至本报告期末，本基金无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

截至本报告期末，本基金无贵金属投资收益—赎回差价收入。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

截至本报告期末，本基金无贵金属投资收益—申购差价收入。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.17 衍生工具收益**7.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

截至本报告期末，本基金无衍生工具收益—买卖权证差价收入。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

截至本报告期末，本基金无衍生工具收益—其他投资收益。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	-
基金投资产生的股利收益	1,431,666.90
合计	1,431,666.90

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	7,676,179.01
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	7,676,179.01
——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	7,676,179.01

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	535,234.97
其他	74,035.86
合计	609,270.83

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,637.96
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	682,127.27
其中：申购费	63,993.57
赎回费	530,417.34
转换费	87,716.36
合计	683,765.23

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.21.1 持有基金产生的费用

项目	本期
	2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	106,044.60
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	886,904.13
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	171,543.18

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	80,000.00

信息披露费	81,967.21
债券账户维护费	0.00
汇划手续费	5,720.40
其他	400.00
合计	168,087.61

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

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 2020 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

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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
中国农业银行股份有限公司	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
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
恒泰证券股份有限公司	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

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联交易单元进行股票交易。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联交易单元进行权证交易。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未通过关联交易单元进行债券交易。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联交易单元进行回购交易。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末无应支付关联方的佣金。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

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
	2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	814,842.43
其中：支付销售机构的客户维护费	431,785.50

注：1、本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金管理人管理的基金部分的余额（若为负数，则取 0）的 1.00% 年费率计提。

2、本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	149,959.76

注：1、本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金托管人托管的基金部分的余额（若为负数，则取 0）的 0.20% 的年费率计提。

2、本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.10.2.3 销售服务费

- 1、本基金无销售服务费。
- 2、本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

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

本报告期本基金无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.10.4 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 2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有 限公司	6,483,674.26	52,865.97

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.10.5 其他关联交易事项的说明**7.4.10.5.1 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**

项目	本期费用 2020年4月26日（基金合同生效日）至2020年12月31日
	当期交易基金产生的申购费（元）
当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	9,310.62
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	52,887.44
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	9,258.41

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 12 月 31 日成立未满一年。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 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

截至本报告期末，本基金未持有受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末本基金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

截至本报告期末本基金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

- 1.本基金于 2020 年 4 月 26 日成立。
- 2.本报告期末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

- 1.本基金于 2020 年 4 月 26 日成立。
- 2.本报告期末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

- 1.本基金于 2020 年 4 月 26 日成立。
- 2.本报告期末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

- 1.本基金于 2020 年 4 月 26 日成立。
- 2.本报告期末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

- 1.本基金于 2020 年 4 月 26 日成立。
- 2.本报告期末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

- 1.本基金于 2020 年 4 月 26 日成立。
- 2.本报告期末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

7.4.13.4 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 2020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	6,483,674.26	-	-	-	6,483,674.26
结算备付金	17,998.13	-	-	-	17,998.13
存出保证金	5,719.59	-	-	-	5,719.59
交易性金融资产	-	-	-	73,690,109.05	73,690,109.05
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	-	-	-	1,359.83	1,359.83
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	414,035.67	414,035.67
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,507,391.98	-	-	74,105,504.55	80,612,896.53
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	-	-	-	443,791.61	443,791.61
应付管理人报酬	-	-	-	52,706.64	52,706.64
应付托管费	-	-	-	10,966.28	10,966.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	162,396.40	162,396.40
负债总计	-	-	-	669,860.93	669,860.93
利率敏感度缺口	6,507,391.98	-	-	73,435,643.62	79,943,035.60

注：1.本基金于 2020 年 4 月 26 日成立。

2.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

1.本基金于 2020 年 4 月 26 日成立。

2.本报告期末，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和债券，所面临的最大的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 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	73,690,109.05	92.18
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	73,690,109.05	92.18

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%或者下降 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12月31日
	沪深 300 指数上升 1%	增加约 680,642.51
	沪深 300 指数下降 1%	减少约 680,642.51

注: 本基金于 2020 年 4 月 26 日成立。

§ 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	-	-
	其中: 股票	-	-
2	基金投资	73,690,109.05	91.41
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	6,501,672.39	8.07
8	其他各项资产	421,115.09	0.52
9	合计	80,612,896.53	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪股通投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买卖股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买卖股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未买卖股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未持有债券。

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

本基金本报告期内未投资债券。

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。

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。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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 投资政策及风险说明

本基金为成长主题混合型基金中基金，主要投资于风格稳定、管理人综合实力较强、持续业绩良好的成长风格基金，力图分享中国经济的增长红利。同时再辅以科学、全面的风险控制，可以有效保障本基金实现长期稳定增值的投资目标。成长风格基金主要投资于信誉良好、具有良好增长潜力的上市公司股票或其他证券，重视资金的长期成长，追求资产的稳定、持续的长期增值。

具体筛选方法是：1) 将基金收益率序列与相应风格指数收益序列数据进行多因子回归，根据全部样本基金成长因子与价值因子得分分别进行百分位分级靠档，通过比较单个基金在参评基金样本中的风格特征显著度判定基金风格；2) 运用“分级靠档”方法，划分多个评价层次，对筛选出的成长风格金牛基金进行进一步风格细分；3) 从各评价层次中精选出其中长期业绩表现平稳、市场流动性良好、综合评分排名靠前的基金品种组成金牛成长核心基金池。

(2) 构建重点投资基金池

通过基金管理人自主建立的“定量+定性”综合基金研究评价体系，对全市场公开募集的开放式证券投资基金进行细致分类、科学定量和详细定性研究，并综合当前市场环境及预期收益目标、业绩比较基准、组合流动型等因素，形成重点投资基金池。

1) 构建初选基金池

初选基金池的筛选以定量分析方法为主。研究内容包括历史业绩分析和风险分析。其中基金历史业绩分析包括绝对和相对收益分析；风险分析包括确认基金总体投资风险水平适当可控，分析风险的

来源以及基金风险调整后的收益。根据管理人设定的综合打分评价结果形成初选基金池。

2) 构建重点基金池

在初选基金池的基础上，结合对基金公司和基金经理的定量及定性分析，形成重点基金池。对基金公司和基金经理的评价从以下几个方面进行：

基金经理：年龄、性别、从业背景、投资年限、投资风格、业绩归因、收益及风险控制能力等；

基金管理人：公司历史、管理规模和公司管理层、股东结构、产品种类、竞争优势、主要客户和过往法律纠纷等；

基金公司投资流程：基金决策机制、业绩增长模式（依靠人员还是依靠流程）、投资人员和研究人员的权责划分、研究优势、信息来源和独立研究机构和卖方机构研究支持等；

基金管理团队：团队结构、成员职责和从业经历、团队的绩效评价体系和备选基金的基金经理管理其他基金的情况；

风险控制：公司风险控制体系、流程、员工风险意识、风险事故汇报路径和重大事件的应急处理方案。

(3) 构建基金投资组合

基金管理人将同时入选金牛成长核心基金池和重点投资基金池的优质基金组成“精选成长组合”。本基金以“精选成长组合”为投资重点，投资于该组合的比例不低于非现金基金资产 80%。在综合考虑组合流动性、相关性及投资成本等因素的基础上，辅以重点投资基金池中精选出的其他优质基金进行投资。

(4) 基金投资组合的动态调整

本基金管理人每月对基金组合进行检查，识别单只基金的表现并进行评估；每季度将会评估市场环境，对基金池进行筛选重排，在权衡调仓成本和预期收益的基础上决定是否进行调仓操作。

当市场发生极端行情、单只基金出现净值异常波动或其他重大事件时将即时启动风险评估，并适时调整基金组合。

通过上述动态调整机制，控制基金组合的风格漂移和业绩波动等风险，力求使得基金组合整体所承担的风险水平相对合理，实现组合资产的安全性、稳定性和盈利性。

8.12.2 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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
----	------	------	------	-------------	-------------	----------------------	------------------------------------

1	519091	新华泛资源优势混合	契约型开放式	1,266,484.31	7,278,485.33	9.10%	是
2	004231	中欧行业成长混合(LOF)C	契约型开放式	2,697,237.57	6,261,367.29	7.83%	否
3	001714	工银文体产业股票	契约型开放式	1,643,458.28	5,438,203.45	6.80%	否
4	519700	交银主题优选混合	契约型开放式	2,753,844.62	5,386,520.08	6.74%	否
5	540009	汇丰晋信消费红利	契约型开放式	2,709,918.42	3,822,881.92	4.78%	否
6	161903	万家行业优选混合(LOF)	契约型开放式	1,715,904.82	3,792,836.01	4.74%	否
7	163415	兴全商业模式优选混合(LOF)	契约型开放式	1,006,907.64	3,775,903.65	4.72%	否
8	213001	宝盈鸿利收益混合A	契约型开放式	1,451,684.18	3,716,311.50	4.65%	否
9	001878	嘉实沪港深精选股票	契约型开放式	1,522,194.31	3,584,767.60	4.48%	否
10	001410	信达澳银新能源产业股票	契约型开放式	945,917.13	3,490,434.21	4.37%	否
11	270021	广发聚瑞混合	契约型开放式	751,535.18	3,347,563.15	4.19%	否
12	202023	南方优选成长混合A	契约型开放式	620,402.52	3,038,111.14	3.80%	否
13	217010	招商大盘蓝筹混合	契约型开放式	733,604.25	2,434,098.90	3.04%	否
14	512760	国泰CES半导体ETF	契约型开放式	2,004,700.00	2,387,597.70	2.99%	否
15	121006	国投瑞银稳健增长	契约型开放式	853,241.59	2,317,404.16	2.90%	否
16	162712	广发聚利债券(LOF)A	契约型开放式	1,547,823.99	2,238,463.05	2.80%	否
17	002692	富国创新	契约型开	832,095.5	2,185,914.	2.73%	否

		科技混合	放式	1	90		
18	512880	国泰中证全指证券公司 ETF	契约型开放式	1,710,800.00	2,090,597.60	2.62%	否
19	512290	国泰中证生物医药 ETF	契约型开放式	1,065,400.00	2,044,502.60	2.56%	否
20	460005	华泰柏瑞价值增长混合	契约型开放式	374,008.07	2,016,464.51	2.52%	否
21	512800	华宝中证银行 ETF	契约型开放式	1,516,300.00	1,736,163.50	2.17%	否
22	512660	国泰中证军工 ETF	契约型开放式	1,013,600.00	1,305,516.80	1.63%	否

8.13 投资组合报告附注

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

8.13.2 本基金未投资股票。

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	5,719.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,359.83
5	应收申购款	414,035.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	421,115.09

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 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
1,627	38,918.67	0.00	0.00%	63,320,677.50	100.00%

9.2 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	32,881.16	0.05%

9.3 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	0~10
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(2020年4月26日)基金	222,428,427.57
-----------------------	----------------

份额总额	
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	39,015,879.09
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	198,123,629.16
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	63,320,677.50

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金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

2020年6月5日，崔建波先生、晏益民先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理职务。

2020年9月14日，刘征宇先生、申峰旗先生担任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理职务。

2020年11月30日，刘全胜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职务，翟晨曦女士担任总经理（代行）职务。

2020年8月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未有涉及基金管理人、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

2021年2月1日，本基金会计师事务所由瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）变更为致同会计

师事务所（特殊普通合伙），报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。审计年限为 1 年。自 2020 年，致同会计师事务所为本基金连续提供 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

本基金管理人报告期由于内部控制制度不完善，现有制度未得到有效执行，收到重庆证监局出具的责令改正并暂停相关业务的行政监管措施，对相关责任人采取出具警示函的行政监管措施，对分管高管采取认定为不适当人选措施的决定，目前公司正在整改进行中。

本基金管理人报告期由于基金收益分配流程控制不严格，收到重庆监管局采取出具警示函的行政监管措施。

本基金托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-

华泰证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-

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44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。新增席位为：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。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-	1,499,985.60	4.12%
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	9,488,571.30	26.07%
中银国际	-	-	-	-	-	-	4,745,982.70	13.04%
中信证券	-	-	-	-	-	-	3,994,093.80	10.97%
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	7,073,416.90	19.43%
国盛证券	-	-	-	-	-	-	9,593,510.20	26.36%

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部分销售机构停止销售新华精选成长主题 3 个月持有期混合型 FOF 基金份额的公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-03-31
2	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）增加销售机构的公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-04-01
3	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）增加销售机构的公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-04-02
4	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中证金牛（北京）投资咨询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	2020-04-03
5	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金	证券日报、公司网站、	2020-04-03

	中基金(FOF)增加销售机构的公告	电子信披网站	
6	新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)增加湘财证券股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-04-08
7	新华基金管理股份有限公司关于新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)延长募集期的公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-04-15
8	新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)增加光大证券股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-04-15
9	新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)提前结束募集的公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-04-22
10	新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同生效公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-04-27
11	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
12	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
13	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
14	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金2020年第2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	2020-07-17
15	新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)2020年第2季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-07-17
16	新华基金管理股份有限公司关于暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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	2020-08-14
17	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁(杭州)基金销售有限公司为代销机构并开通相关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	2020-08-14
18	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金2020年中期报告提示性公告	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	2020-08-27
19	新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)2020年中期报告	公司网站、电子信披网站	2020-08-27
20	新华精选成长主题3个月持有期混合型基金	证券日报、公司网站、	2020-08-28

	中基金(FOF)基金产品资料概要(更新)	电子信披网站	
21	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	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-09-16
22	新华基金管理股份有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-09-18
23	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)2020 年第 3 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-10-27
24	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 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	2020-10-27
25	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构并开通相关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	2020-11-16
26	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	证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-12-01
27	新华基金管理股份有限公司关于直销农行网银支付业务下线的公告	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	2020-12-17

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)募集的文件
- (二)关于申请募集新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)之法律意见书
- (三)新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同
- (四)新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)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)《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》(更新)
- (七)《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金产品资料概要》(更新)

(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)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

二〇二一年三月三十日