

# 新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金

**2021 年中期报告**

**2021 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月二十七日

## 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 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> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
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等内容的真实、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.....	12
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> .....	57
7.1 期末基金资产组合情况.....	57
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
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.....	65
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.....	65
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.....	66
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	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债券投资明细.....	69
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.....	69
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.....	70
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	70
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.13 投资组合报告附注.....	72
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74

8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	76
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	77
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	78
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>80</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>81</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	81
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 .....	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	81
10.4 基金投资策略的改变 .....	81
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	81
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 .....	81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	81
10.8 其他重大事件 .....	82
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>84</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>84</b>
12.1 备查文件目录 .....	84
12.2 存放地点 .....	84
12.3 查阅方式 .....	85

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新华恒益量化灵活配置混合
基金主代码	004576
交易代码	004576
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月1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	59,760,610.47 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化投资模型，在严格控制风险的前提下进行大类资产配置和个股精选，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现资产长期稳健增值。
投资策略	本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，并利用数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻择时和选股全程数量化的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率 ×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等预期风险、中等预期收益品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国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	北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座F9

	淀区西三环北路11号海通时代 商务中心C1座	
邮政编码	400010	100031
法定代表人	翟晨曦	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	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（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	13,431,589.89
本期利润	1,322,021.04
加权平均基金份额本期利润	0.0180
本期加权平均净值利润率	1.67%
本期基金份额净值增长率	1.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	4,098,320.28
期末可供分配基金份额利润	0.0686
期末基金资产净值	63,858,930.75
期末基金份额净值	1.0686
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	6.86%

### 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

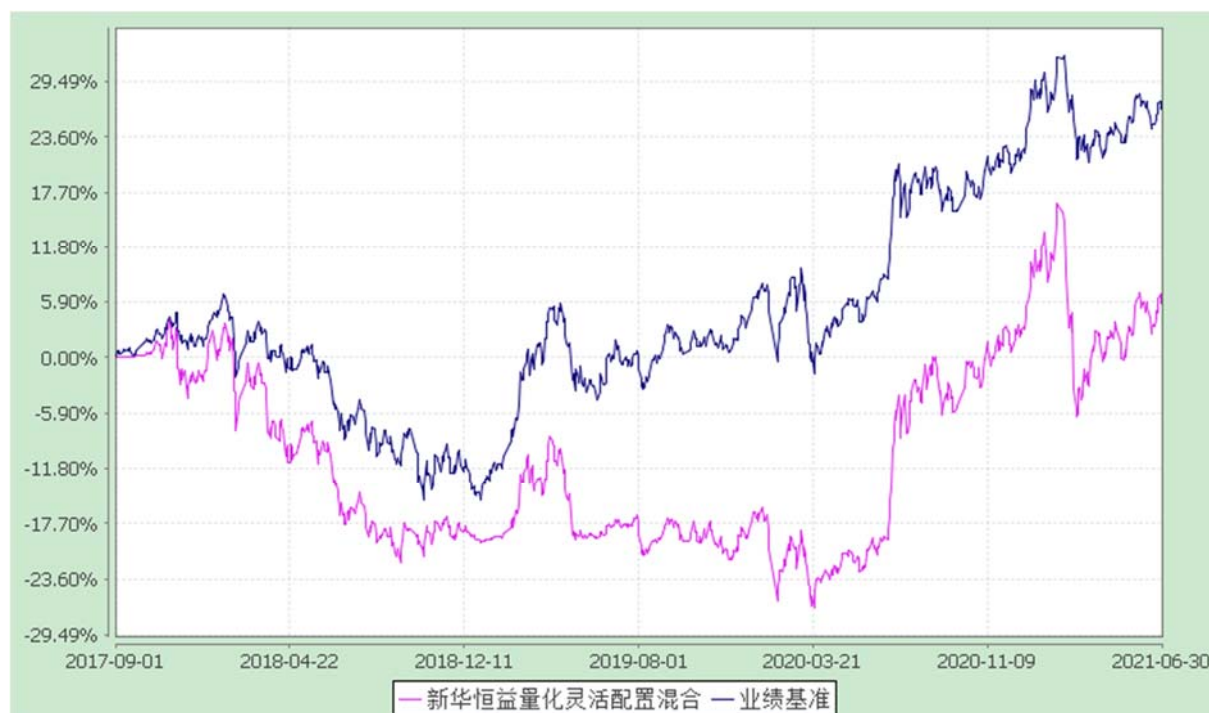
过去一个月	0.25%	0.82%	-0.77%	0.50%	1.02%	0.32%
过去三个月	6.06%	0.88%	3.51%	0.57%	2.55%	0.31%
过去六个月	1.30%	1.40%	2.09%	0.79%	-0.79%	0.61%
过去一年	31.10%	1.32%	16.13%	0.83%	14.97%	0.49%
过去三年	26.48%	1.06%	35.14%	0.88%	-8.66%	0.18%
自基金合同生效起至今	6.86%	1.05%	27.06%	0.84%	-20.20%	0.21%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中证 800 指数收益率×65%+中证综合债券指数收益率 ×35%。

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

新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2017 年 9 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）



注：1、本基金于 2017 年 9 月 1 日基金合同生效。

2、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 2021 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十二只开放式基金，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、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置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		
钟俊	本基金基金经理，新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理。	2020-04-02	2021-04-12	12	金融学硕士，历任新华基金风险与量化研究员，行业研究员，行业组长，基金经理助理。
武磊	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经理。	2021-02-22	-	6	工商管理硕士，历任中信保诚人寿资产管理中心投资经理助理；曾任职于嘉实基金管理有限公司人工智能研究部，从事智能量化投资策略研究工作。

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一

二级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的内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

2021 年上半年市场呈现结构化行情，顺周期低估值板块与成长板块轮换较快。上半年，组合总体采取均衡配置思路，各风格因子保持适度均衡，不在单个风格因子上做过多或者过少的风险暴露。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0686 元，本报告其份额净值增长率为 1.30%，同期比较基准的增长率为 2.09%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，市场结构化行情延续，组合将继续保持上半年均衡配置思路，在大类因子层面保持适度均衡，力争获取较好的投资回报。

### 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

本报告期本基金从 2021 年 3 月 4 日到 2021 年 5 月 28 日连续 58 个工作日基金资产净值低于五千万元。

### 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

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	4,085,078.43	62,413,407.14
结算备付金		305,344.16	447,627.04
存出保证金		97,315.05	47,675.34
交易性金融资产	6.4.7.2	59,851,146.09	140,165,963.25
其中：股票投资		59,851,146.09	140,143,452.39
基金投资		-	-
债券投资		-	22,510.86
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		8,230.71	20,498.87
应收利息	6.4.7.5	892.51	2,828.31
应收股利		-	-
应收申购款		29.96	434.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>64,348,036.91</b>	<b>203,098,434.30</b>

负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<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		43,442.41	525,557.84
应付管理人报酬		77,207.65	174,002.90
应付托管费		12,867.94	29,000.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	256,409.19	430,822.95
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	99,178.97	160,012.47
<b>负债合计</b>		<b>489,106.16</b>	<b>1,319,396.64</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	59,760,610.47	191,281,789.08
未分配利润	6.4.7.10	4,098,320.28	10,497,248.58
<b>所有者权益合计</b>		<b>63,858,930.75</b>	<b>201,779,037.66</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>64,348,036.91</b>	<b>203,098,434.30</b>

注：本报告期末基金份额净值 1.0686 元，基金份额总额 59,760,610.47 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>3,389,749.05</b>	<b>702,733.78</b>
1.利息收入		42,037.26	81,415.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	42,035.05	78,643.30
债券利息收入		2.21	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,772.36
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,983,178.73	-901,894.74

其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,644,906.41	-1,659,322.82
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	3,331.95	-
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	6.4.7.18	334,940.37	757,428.08
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-12,109,568.85	1,485,944.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	474,101.91	37,268.12
<b>减：二、费用</b>		<b>2,067,728.01</b>	<b>1,356,689.53</b>
1. 管理人报酬		612,390.56	691,282.90
2. 托管费		102,065.05	115,213.85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	1,249,339.63	467,686.41
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	6.4.7.22	103,932.77	82,506.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,322,021.04</b>	<b>-653,955.75</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,322,021.04</b>	<b>-653,955.75</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	191,281,789.08	10,497,248.58	201,779,037.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,322,021.04	1,322,021.04
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）	-131,521,178.61	-7,720,949.34	-139,242,127.95
其中：1.基金申购款	47,381,683.41	2,952,354.09	50,334,037.50
2.基金赎回款	-178,902,862.02	-10,673,303.43	-189,576,165.45

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）	59,760,610.47	4,098,320.28	63,858,930.75
项目	上年度可比期间 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）	95,129,604.43	-16,628,514.31	78,501,090.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-653,955.75	-653,955.75
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）	76,293,577.89	-14,418,779.83	61,874,798.06
其中：1.基金申购款	107,635,990.68	-21,171,135.30	86,464,855.38
2.基金赎回款	-31,342,412.79	6,752,355.47	-24,590,057.32
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）	171,423,182.32	-31,701,249.89	139,721,932.43

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：翟晨曦，主管会计工作负责人：于春玲，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

新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]509 号文件“关于核准新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金募集的批复”,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2017 年 7 月 31 日至 8 月 25 日向社会公开募集,首次募集资金总额 298,630,440.50 元,其中募集净认购资金金额 298,526,457.70 元,募集资金产生利息 103,982.80 元,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2017]第 01360033 号验资报告予以验证。2017 年 9 月 1 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



国农业银行股份有限公司。

根据《新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要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（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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 0-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金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。本基金的业绩比较基准为： $65\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 35\% \times \text{中证综合债券指数收益率}$ 。

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 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 42 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”），中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》，《新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动等有关信息。

#### 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政策和会计估计与最近一期年度报告一致。

## 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。

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。

### 3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

## 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	4,085,078.43
定期存款	-
其他存款	-
合计	4,085,078.43

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	58,935,495.01	59,851,146.09	915,651.08
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	58,935,495.01	59,851,146.09	915,651.08

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金报告期末未持有金融衍生资产和负债。

#### 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

本基金报告期末无买入返售金融资产期末余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金报告期末无买断式逆回购。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	729.43
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	163.08
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	892.51

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日

交易所市场应付交易费用	256,409.19
银行间市场应付交易费用	-
合计	256,409.19

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.02
应付证券出借违约金	-
预提费用	99,178.95
合计	99,178.97

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	191,281,789.08	191,281,789.08
本期申购	47,381,683.41	47,381,683.41
本期赎回（以“-”号填列）	-178,902,862.02	-178,902,862.02
本期末	59,760,610.47	59,760,610.47

注：申购含红利再投、转换入份额、赎回含转换出份额。

## 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	1,176,789.85	9,320,458.73	10,497,248.58
本期利润	13,431,589.89	-12,109,568.85	1,322,021.04
本期基金份额交易产生的变动数	791,301.18	-8,512,250.52	-7,720,949.34
其中：基金申购款	11,585,547.80	-8,633,193.71	2,952,354.09
基金赎回款	-10,794,246.62	120,943.19	-10,673,303.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,399,680.92	-11,301,360.64	4,098,320.28

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,914.49
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	6,120.56
其他	-
合计	42,035.05

注：结算备付金利息收入中包含结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	474,603,581.82
减：卖出股票成本总额	459,958,675.41
买卖股票差价收入	14,644,906.41

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	21,036.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,700.00
减：应收利息总额	4.50
买卖债券差价收入	3,331.95

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资。

**6.4.7.17 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具投资。

**6.4.7.18 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	334,940.37
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	334,940.37

**6.4.7.19 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-12,109,568.85
——股票投资	-12,104,757.99
——债券投资	-4,810.86
——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	-12,109,568.85

**6.4.7.20 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	474,101.26
转换费收入	0.65
合计	474,101.91

**6.4.7.21 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,249,339.63
银行间市场交易费用	-
合计	1,249,339.63

#### 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券账户维护费	-
汇划手续费	4,753.82
指数使用费	-
合计	103,932.77

#### 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 2021 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。

#### 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、基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	242,434.00	0.03%	49,487,507.25	14.99%

## 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行权证交易。

## 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行债券交易。

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

## 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 2021年1月1日至2021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	225.77	0.03%	49,416.95	19.27%
关联方名称	上年度可比期间 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	45,384.05	15.76%	45,384.05	13.65%

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	612,390.56	691,282.90
其中：支付销售机构的客户维护费	58,677.00	162,150.03

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提确认。计算公式为：

每日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × (1.5% ÷ 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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	102,065.05	115,213.85

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。计算公式为：每日基金托管费 = 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

本基金本报告期内未发生银行间市场债券（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

本基金本报告期基上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行转融通业务。

### 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固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

### 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
-------	----	---------

	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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
中国农业银行股份有限公司	4,085,078.43	35,914.49	14,164,115.19	76,739.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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

本基金于 2017 年 9 月 1 日成立，至 2021 年 6 月 30 日止无收益分配事项。

#### 6.4.12 期末（2021 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
688456	有研粉材	2021-03-10	2021-09-17	新股锁定期内	10.62	26.50	3,396.00	36,065.52	89,994.00	-
688183	生益电子	2021-02-10	2021-08-25	新股锁定期内	12.42	14.19	5,967.00	74,110.14	84,671.73	-
688329	艾隆科技	2021-03-16	2021-09-29	新股锁定期内	16.81	50.04	1,662.00	27,938.22	83,166.48	-
688633	星球石墨	2021-03-17	2021-09-24	新股锁定期内	33.62	53.14	701.00	23,567.62	37,251.14	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定期内	24.60	163.00	137.00	3,370.20	22,331.00	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定期内	28.77	99.85	202.00	5,811.54	20,169.70	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定	47.33	251.96	74.00	3,502.42	18,645.04	-

				期内						
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定期内	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定期内	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定期内	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定期内	24.69	31.71	394.00	9,727.86	12,493.74	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股锁定期内	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定期内	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定期内	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股锁定期内	8.67	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定期内	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股锁定期内	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定期内	12.85	25.80	264.00	3,392.40	6,811.20	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定期内	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-----	--------------	--------	--------	----

						盘单 价				
688368	晶丰明源	2021-06-21	筹划发行股份	335.26	2021-07-05	402.31	200.00	70,126.00	67,052.00	-
600460	士兰微	2021-06-30	重大资产重组	56.35	2021-07-01	59.49	7,500.00	278,752.03	422,625.00	-

### 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

本基金本报告期末未有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

本基金本报告期末未有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

本基金本报告期内未参与转融通业务。

## 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：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 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 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 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	22,510.86
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	22,510.86

注：本报告期末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资。

#### 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 2021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	4,085,078.43	-	-	-	4,085,078.43
结算备付金	305,344.16	-	-	-	305,344.16
存出保证金	97,315.05	-	-	-	97,315.05
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	59,851,146.09	59,851,146.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	8,230.71	8,230.71
应收利息	-	-	-	892.51	892.51
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	29.96	29.96
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	4,487,737.64	0.00	0.00	59,860,299.27	64,348,036.91
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	0.00	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	43,442.41	43,442.41
应付管理人报酬	-	-	-	77,207.65	77,207.65
应付托管费	-	-	-	12,867.94	12,867.94
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	256,409.19	256,409.19
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	0.00	0.00



应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	99,178.97	99,178.97
负债总计	0.00	0.00	0.00	489,106.16	489,106.16
利率敏感度缺口	4,487,737.64	0.00	0.00	59,371,193.11	63,858,930.75
上年度末 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	62,413,407.14	-	-	-	62,413,407.14
结算备付金	447,627.04	-	-	-	447,627.04
存出保证金	47,675.34	-	-	-	47,675.34
交易性金融资产	-	-	22,510.86	140,143,452.39	140,165,963.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	20,498.87	20,498.87
应收利息	-	-	-	2,828.31	2,828.31
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	434.35	434.35
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	62,908,709.52	-	22,510.86	140,167,213.92	203,098,434.30
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	-	-	-	525,557.84	525,557.84
应付管理人报酬	-	-	-	174,002.90	174,002.90
应付托管费	-	-	-	29,000.48	29,000.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	430,822.95	430,822.95
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	160,012.47	160,012.47
负债总计	-	-	-	1,319,396.64	1,319,396.64
利率敏感度缺口	62,908,709.52	-	22,510.86	138,847,817.28	201,779,037.66

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25bp	0.00	-334.11
	市场利率下降 25bp	0.00	340.03

注：本报告期末，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 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。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	59,851,146.09	93.72	140,143,452.39	69.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	22,510.86	0.01
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	59,851,146.09	93.72	140,165,963.25	69.47

#### 6.4.13.4.2.2 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	607,719.27	1,420,239.75
	沪深 300 指数下降 1%	-607,719.27	-1,420,239.75

### 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	59,851,146.09	93.01
	其中：股票	59,851,146.09	93.01
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	4,390,422.59	6.82
8	其他各项资产	106,468.23	0.17
9	合计	64,348,036.91	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	195,840.40	0.31
B	采矿业	1,522,311.00	2.38
C	制造业	35,168,927.98	55.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	601,500.00	0.94
E	建筑业	234,171.44	0.37
F	批发和零售业	424,559.36	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	1,464,474.00	2.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,725,561.40	2.70
J	金融业	13,428,060.84	21.03
K	房地产业	851,684.00	1.33
L	租赁和商务服务业	1,946,490.40	3.05
M	科学研究和技术服务业	1,395,222.40	2.18
N	水利、环境和公共设施管理业	17,050.08	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	779,911.54	1.22
R	文化、体育和娱乐业	95,381.25	0.15
S	综合	-	-
	合计	59,851,146.09	93.72

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未投资港股通投资股票。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,800	3,702,060.00	5.80
2	601318	中国平安	34,403	2,211,424.84	3.46
3	600036	招商银行	36,000	1,950,840.00	3.05
4	601888	中国中免	4,194	1,258,619.40	1.97
5	000858	五粮液	4,100	1,221,349.00	1.91
6	601398	工商银行	226,600	1,171,522.00	1.83
7	601166	兴业银行	52,100	1,070,655.00	1.68
8	000333	美的集团	14,739	1,051,922.43	1.65
9	603259	药明康德	6,360	995,912.40	1.56
10	600887	伊利股份	26,000	957,580.00	1.50
11	603501	韦尔股份	2,900	933,800.00	1.46
12	600309	万华化学	8,200	892,324.00	1.40
13	601919	中远海控	28,300	864,282.00	1.35
14	002460	赣锋锂业	6,100	738,649.00	1.16
15	000651	格力电器	13,900	724,190.00	1.13
16	600809	山西汾酒	1,600	716,800.00	1.12
17	000100	TCL 科技	93,000	711,450.00	1.11
18	002027	分众传媒	73,100	687,871.00	1.08
19	601211	国泰君安	39,700	680,458.00	1.07
20	600690	海尔智家	26,000	673,660.00	1.05
21	603986	兆易创新	3,500	657,650.00	1.03
22	601100	恒立液压	7,400	635,808.00	1.00
23	000063	中兴通讯	19,000	631,370.00	0.99
24	600019	宝钢股份	80,400	614,256.00	0.96
25	601328	交通银行	123,200	603,680.00	0.95
26	300014	亿纬锂能	5,800	602,794.00	0.94
27	601688	华泰证券	36,800	581,440.00	0.91
28	603806	福斯特	5,300	557,189.00	0.87
29	603486	科沃斯	2,400	547,392.00	0.86
30	601857	中国石油	102,800	543,812.00	0.85
31	300122	智飞生物	2,900	541,517.00	0.85
32	300327	中颖电子	6,300	536,949.00	0.84
33	300750	宁德时代	1,000	534,800.00	0.84
34	600028	中国石化	121,900	531,484.00	0.83
35	601636	旗滨集团	28,200	523,392.00	0.82

36	601988	中国银行	169,800	522,984.00	0.82
37	601633	长城汽车	11,500	501,285.00	0.78
38	600588	用友网络	15,000	498,900.00	0.78
39	601939	建设银行	73,900	491,435.00	0.77
40	000776	广发证券	32,200	487,508.00	0.76
41	603659	璞泰来	3,500	478,100.00	0.75
42	601600	中国铝业	89,300	473,290.00	0.74
43	300724	捷佳伟创	4,000	464,040.00	0.73
44	603882	金域医学	2,900	463,333.00	0.73
45	300463	迈克生物	11,000	462,990.00	0.73
46	601006	大秦铁路	69,800	459,284.00	0.72
47	300033	同花顺	3,900	439,842.00	0.69
48	002080	中材科技	16,600	434,422.00	0.68
49	601689	拓普集团	11,500	430,445.00	0.67
50	600460	士兰微	7,500	422,625.00	0.66
51	002179	中航光电	5,300	418,806.00	0.66
52	300124	汇川技术	5,550	412,143.00	0.65
53	601012	隆基股份	4,200	373,128.00	0.58
54	000786	北新建材	9,300	365,025.00	0.57
55	601899	紫金矿业	37,600	364,344.00	0.57
56	601607	上海医药	16,600	350,758.00	0.55
57	600919	江苏银行	47,700	338,670.00	0.53
58	000001	平安银行	14,900	337,038.00	0.53
59	600132	重庆啤酒	1,600	316,720.00	0.50
60	000661	长春高新	800	309,600.00	0.48
61	002049	紫光国微	2,000	308,380.00	0.48
62	002648	卫星石化	7,700	301,763.00	0.47
63	300059	东方财富	9,100	298,389.00	0.47
64	603392	万泰生物	1,140	295,465.20	0.46
65	002475	立讯精密	6,400	294,400.00	0.46
66	600276	恒瑞医药	4,200	285,474.00	0.45
67	000733	振华科技	4,600	280,922.00	0.44
68	002311	海大集团	3,400	277,440.00	0.43
69	603833	欧派家居	1,900	269,724.00	0.42
70	002938	鹏鼎控股	7,318	262,569.84	0.41
71	002408	齐翔腾达	21,100	262,062.00	0.41
72	603678	火炬电子	3,700	249,750.00	0.39
73	002603	以岭药业	8,300	242,028.00	0.38
74	002241	歌尔股份	5,600	239,344.00	0.37
75	601138	工业富联	19,100	237,031.00	0.37
76	601985	中国核电	45,500	230,230.00	0.36
77	300676	华大基因	1,900	225,340.00	0.35
78	600867	通化东宝	18,300	218,502.00	0.34
79	600208	新潮中宝	70,300	213,712.00	0.33

80	000568	泸州老窖	900	212,346.00	0.33
81	603444	吉比特	400	212,000.00	0.33
82	600000	浦发银行	21,200	212,000.00	0.33
83	600837	海通证券	18,300	210,450.00	0.33
84	000012	南玻A	20,500	209,920.00	0.33
85	603589	口子窖	3,100	209,839.00	0.33
86	002508	老板电器	4,500	209,250.00	0.33
87	300009	安科生物	14,000	208,600.00	0.33
88	000423	东阿阿胶	5,800	208,278.00	0.33
89	300253	卫宁健康	12,700	206,629.00	0.32
90	600482	中国动力	11,600	202,072.00	0.32
91	601818	光大银行	53,300	201,474.00	0.32
92	002714	牧原股份	3,220	195,840.40	0.31
93	300015	爱尔眼科	2,723	193,278.54	0.30
94	600741	华域汽车	7,300	191,771.00	0.30
95	601128	常熟银行	30,500	189,100.00	0.30
96	300408	三环集团	4,400	186,648.00	0.29
97	600201	生物股份	10,400	181,480.00	0.28
98	002032	苏泊尔	2,800	178,612.00	0.28
99	300347	泰格医药	900	173,970.00	0.27
100	300529	健帆生物	1,950	168,402.00	0.26
101	000961	中南建设	27,200	161,024.00	0.25
102	300142	沃森生物	2,600	160,420.00	0.25
103	601881	中国银河	14,700	158,466.00	0.25
104	601799	星宇股份	700	158,004.00	0.25
105	000725	京东方A	25,000	156,000.00	0.24
106	601377	兴业证券	15,900	153,594.00	0.24
107	600498	烽火通信	8,100	150,903.00	0.24
108	600845	宝信软件	2,860	145,574.00	0.23
109	600999	招商证券	7,600	144,552.00	0.23
110	002129	中环股份	3,700	142,820.00	0.22
111	001979	招商蛇口	12,800	140,160.00	0.22
112	002008	大族激光	3,300	133,287.00	0.21
113	600703	三安光电	4,000	128,200.00	0.20
114	600705	中航资本	32,900	127,323.00	0.20
115	300496	中科创达	800	125,648.00	0.20
116	600763	通策医疗	300	123,300.00	0.19
117	600030	中信证券	4,800	119,712.00	0.19
118	000625	长安汽车	4,500	118,260.00	0.19
119	600031	三一重工	4,000	116,280.00	0.18
120	002410	广联达	1,700	115,940.00	0.18
121	603799	华友钴业	1,000	114,200.00	0.18
122	002736	国信证券	10,500	112,875.00	0.18
123	002245	蔚蓝锂芯	5,700	112,290.00	0.18

124	600346	恒力石化	4,200	110,208.00	0.17
125	002415	海康威视	1,700	109,650.00	0.17
126	002709	天赐材料	1,000	106,580.00	0.17
127	600390	五矿资本	17,600	105,248.00	0.16
128	601169	北京银行	21,200	103,244.00	0.16
129	600570	恒生电子	1,100	102,575.00	0.16
130	601117	中国化学	11,700	102,492.00	0.16
131	601628	中国人寿	3,000	101,670.00	0.16
132	603077	和邦生物	48,200	100,256.00	0.16
133	300003	乐普医疗	3,100	99,572.00	0.16
134	600111	北方稀土	4,800	99,360.00	0.16
135	600176	中国巨石	6,200	96,162.00	0.15
136	300653	正海生物	1,200	93,960.00	0.15
137	600196	复星医药	1,300	93,769.00	0.15
138	601108	财通证券	8,600	90,214.00	0.14
139	688456	有研新材	3,396	89,994.00	0.14
140	600369	西南证券	18,200	88,634.00	0.14
141	002230	科大讯飞	1,300	87,854.00	0.14
142	601155	新城控股	2,100	87,360.00	0.14
143	600702	舍得酒业	400	85,512.00	0.13
144	688183	生益电子	5,967	84,671.73	0.13
145	600900	长江电力	4,100	84,624.00	0.13
146	688036	传音控股	400	83,800.00	0.13
147	688329	艾隆科技	1,662	83,166.48	0.13
148	600483	福能股份	7,900	82,871.00	0.13
149	600025	华能水电	14,100	81,639.00	0.13
150	300207	欣旺达	2,500	81,400.00	0.13
151	002601	龙蟠佰利	2,300	79,534.00	0.12
152	600989	宝丰能源	5,700	77,976.00	0.12
153	603288	海天味业	600	77,370.00	0.12
154	600018	上港集团	15,900	75,843.00	0.12
155	000560	我爱我家	16,900	75,543.00	0.12
156	603466	风语筑	4,575	74,801.25	0.12
157	300573	兴齐眼药	500	70,515.00	0.11
158	300458	全志科技	800	70,128.00	0.11
159	000157	中联重科	7,400	68,376.00	0.11
160	000671	阳光城	12,900	67,080.00	0.11
161	688368	晶丰明源	200	67,052.00	0.11
162	300628	亿联网络	800	67,040.00	0.10
163	600068	葛洲坝	8,900	66,661.00	0.10
164	600233	圆通速递	6,500	65,065.00	0.10
165	000069	华侨城 A	8,700	64,728.00	0.10
166	600958	东方证券	6,400	63,936.00	0.10
167	000723	美锦能源	7,900	59,724.00	0.09



168	601336	新华保险	1,300	59,683.00	0.09
169	300671	富满电子	440	57,921.60	0.09
170	002558	巨人网络	4,252	56,551.60	0.09
171	000338	潍柴动力	2,700	48,249.00	0.08
172	003816	中国广核	17,900	47,793.00	0.07
173	601390	中国中铁	8,800	46,112.00	0.07
174	002287	奇正藏药	1,700	45,849.00	0.07
175	600436	片仔癀	100	44,830.00	0.07
176	600104	上汽集团	1,800	39,546.00	0.06
177	600699	均胜电子	1,500	38,280.00	0.06
178	002425	凯撒文化	4,500	37,665.00	0.06
179	688633	星球石墨	701	37,251.14	0.06
180	600150	中国船舶	2,200	36,322.00	0.06
181	002414	高德红外	1,300	35,854.00	0.06
182	000425	徐工机械	5,500	35,035.00	0.05
183	600886	国投电力	3,600	34,596.00	0.05
184	600522	中天科技	3,400	34,000.00	0.05
185	601088	中国神华	1,500	29,280.00	0.05
186	002285	世联行	4,700	28,811.00	0.05
187	002050	三花智控	1,200	28,776.00	0.05
188	300755	华致酒行	700	28,567.00	0.04
189	601898	中煤能源	3,900	27,885.00	0.04
190	600295	鄂尔多斯	1,500	26,835.00	0.04
191	600338	西藏珠峰	1,800	25,506.00	0.04
192	603899	晨光文具	300	25,368.00	0.04
193	000708	中信特钢	1,200	25,008.00	0.04
194	600655	豫园股份	2,000	23,180.00	0.04
195	300919	中伟股份	137	22,331.00	0.03
196	600011	华能国际	5,100	21,522.00	0.03
197	300413	芒果超媒	300	20,580.00	0.03
198	300953	震裕科技	202	20,169.70	0.03
199	002847	盐津铺子	200	19,944.00	0.03
200	300957	贝泰妮	74	18,645.04	0.03
201	603043	广州酒家	700	18,004.00	0.03
202	601717	郑煤机	1,400	16,282.00	0.03
203	600563	法拉电子	100	15,836.00	0.02
204	600674	川投能源	1,100	13,563.00	0.02
205	300940	南极光	307	13,317.66	0.02
206	600185	格力地产	1,800	13,266.00	0.02
207	300937	药易购	244	13,105.24	0.02
208	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.02
209	300932	三友联众	394	12,493.74	0.02
210	603171	税友股份	586	11,251.20	0.02
211	605287	德才股份	349	11,014.44	0.02

212	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.02
213	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.01
214	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.01
215	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.01
216	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
217	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
218	002293	罗莱生活	600	8,034.00	0.01
219	600177	雅戈尔	1,200	7,908.00	0.01
220	300956	英力股份	264	6,811.20	0.01
221	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.01
222	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01
223	601618	中国中冶	1,400	4,172.00	0.01
224	601668	中国建筑	800	3,720.00	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	600519	贵州茅台	10,729,760.80	5.32
2	600809	山西汾酒	9,123,400.00	4.52
3	601318	中国平安	6,821,947.00	3.38
4	601166	兴业银行	6,783,045.00	3.36
5	002142	宁波银行	5,955,691.00	2.95
6	000001	平安银行	5,816,497.00	2.88
7	603501	韦尔股份	5,414,142.96	2.68
8	600926	杭州银行	5,414,127.00	2.68
9	601398	工商银行	5,046,795.00	2.50
10	601888	中国中免	4,736,427.00	2.35
11	600309	万华化学	4,692,812.41	2.33
12	300014	亿纬锂能	4,404,301.82	2.18
13	300124	汇川技术	4,350,451.91	2.16
14	000568	泸州老窖	4,054,092.00	2.01
15	600436	片仔癀	4,009,804.62	1.99
16	600036	招商银行	3,959,896.32	1.96
17	300676	华大基因	3,927,316.00	1.95
18	002508	老板电器	3,882,483.00	1.92
19	600887	伊利股份	3,861,732.00	1.91
20	002607	中公教育	3,811,280.06	1.89

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,不考虑相关交易费用。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	15,502,846.00	7.68
2	601318	中国平安	11,287,749.00	5.59
3	601166	兴业银行	9,037,927.00	4.48
4	002142	宁波银行	7,598,585.00	3.77
5	600809	山西汾酒	7,596,581.00	3.76
6	000001	平安银行	6,911,500.00	3.43
7	000333	美的集团	6,665,358.26	3.30
8	600036	招商银行	6,376,060.00	3.16
9	000858	五粮液	6,371,359.64	3.16
10	601888	中国中免	6,094,057.00	3.02
11	601398	工商银行	5,944,934.00	2.95
12	600926	杭州银行	5,432,125.44	2.69
13	600276	恒瑞医药	5,410,630.40	2.68
14	000568	泸州老窖	5,287,911.00	2.62
15	600309	万华化学	5,177,689.10	2.57
16	603501	韦尔股份	4,934,107.44	2.45
17	002714	牧原股份	4,529,684.96	2.24
18	600887	伊利股份	4,498,454.18	2.23
19	300676	华大基因	4,305,002.00	2.13
20	601377	兴业证券	4,121,168.00	2.04
21	603288	海天味业	4,106,427.90	2.04

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,不考虑相关交易费用。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	391,771,127.10
卖出股票的收入（成交）总额	474,603,581.82

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期无股指期货投资。

### 7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金在股指期货的投资中以套期保值为目的，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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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 本报告期投资基金情况

### 7.11.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 (1) “兴业银行”发行人兴业银行股份有限公司因涉及为无证机构提供转接清算服务等五项违法违规行为受到警告处分，中国人民银行福州中心支行没收违法所得 10,875,088.15 元，处以罚款

13,824,431.23 元。（福银罚字（2020）35 号，2020 年 9 月 4 日）

兴业银行股份有限公司因互联网保险销售行为存在未充分履行《保险法》规定的提示和明确说明义务、可回溯管理不健全等问题，违反《中国银保监会关于规范互联网保险销售行为可回溯管理的通知》相关规定，被中国银保监会消费者权益保护局通报。（银保监消保发（2021）2 号，《关于兴业银行互联网保险销售违规问题的通报》，2021 年 1 月 11 日）

（2）“招商银行”发行人招商银行股份有限公司，因违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财资金池化运作等违规行为，中国银保监会依据《中华人民共和国银行业监督管理法》对该行罚款 7170 万元。（银保监罚决字（2021）16 号，2021 年 5 月 17 日）。

（3）“药明康德”的发行人于 2021 年 6 月 15 日收到上交所对其下达的监管工作函，要求上海瀛翊及药明康德高度重视此次违反承诺减持股份事件，并要求其进行全面自查、整改，及时进行信息披露。

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	97,315.05
2	应收证券清算款	8,230.71
3	应收股利	-
4	应收利息	892.51
5	应收申购款	29.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,468.23

### 7.12.4 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**

本基金本期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**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
824	72,525.01	47,595,960.47	79.64%	12,164,650.00	20.36%

**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9月1日）基金份额总额	298,630,440.50
本报告期期初基金份额总额	191,281,789.08
本报告期基金总申购份额	47,381,683.41
减：本报告期基金总赎回份额	178,902,862.02
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	59,760,610.47
-------------	---------------

## 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

2021 年 4 月 9 日，翟晨曦女士担任本基金基金管理人董事长职务，张宗友先生担任本基金基金管理人联席董事长职务。

2021 年 5 月 26 日，于春玲女士担任本基金基金管理人总经理职务。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 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，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

自 2021 年 1 月 8 日，本基金投资策略增加存托凭证的投资策略。

### 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

为进一步维护基金持有人利益，促进会计师事务所提供更优质的服务，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）。本次变更事项经本基金管理人董事会审议通过，经基金托管人同意，并已向中国证券监督管理委员会及其派出机构报备。

### 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

本基金管理人本报告期收到重庆证监局出具的行政监管措施，目前已采取措施改进。

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。

### 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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
新时代证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	2	223,470,911.45	25.85%	163,422.81	23.61%	-
天风证券	1	151,467,074.30	17.52%	110,767.66	16.00%	-
中泰证券	2	135,260,197.27	15.65%	102,526.19	14.81%	-
国金证券	1	106,883,295.21	12.36%	99,539.40	14.38%	-
华西证券	1	93,993,481.82	10.87%	87,537.40	12.64%	-
国泰君安	1	77,756,647.41	9.00%	72,392.37	10.46%	-
安信证券	1	35,053,393.72	4.06%	25,636.22	3.70%	-
国盛证券	2	19,603,098.67	2.27%	14,335.19	2.07%	-
浙商证券	1	12,995,643.67	1.50%	9,503.57	1.37%	-
中信证券	2	3,349,163.35	0.39%	3,118.79	0.45%	-
华创证券	2	2,734,473.07	0.32%	1,999.81	0.29%	-
兴业证券	1	579,321.00	0.07%	539.48	0.08%	-
东吴证券	1	462,466.47	0.05%	338.18	0.05%	-
中银国际	2	357,120.00	0.04%	261.17	0.04%	-
恒泰证券	2	242,434.00	0.03%	225.77	0.03%	-
银河证券	1	128,700.00	0.01%	94.12	0.01%	-
申万宏源	1	58,725.00	0.01%	54.70	0.01%	-
招商证券	1	8,032.20	0.00%	7.48	0.00%	-

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 43 个交易席位，其中报告期内新增 0 个交易席位，退租 0 个交易席位。

#### 一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

##### 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。



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

## 二、交易席位的选择流程

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

## 三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

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

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
新时代证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	21,036.45	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

## 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	新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告	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	2021-01-04
2	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-08
3	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司基金转换补差费公告	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	2021-01-08
4	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台交易优惠费率的公告	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	2021-01-08
5	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在恒泰证券股份有限公司定期定额投资业务起点金额的公告	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	2021-01-16

6	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 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	2021-01-21
7	新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-01-21
8	新华基金管理股份有限公司基金改聘会计师事务所公告	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	2021-02-03
9	新华基金管理股份有限公司新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2021-02-23
10	新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-02-24
11	新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-02-24
12	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在天风证券股份有限公司定期定额投资业务起点金额的公告	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	2021-02-26
13	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 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	2021-03-30
14	新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2021-03-30
15	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	2021-04-10
16	新华基金管理股份有限公司新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2021-04-13
17	新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-04-14
18	新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-04-14
19	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2021 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	2021-04-21
20	新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-04-21
21	新华基金管理股份有限公司关于法定代表人变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2021-05-08
22	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北京增财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	2021-05-08
23	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证	中国证券报、上海证券	2021-05-11

	券投资基金增加中信期货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	报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	
24	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、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-05-27
25	新华基金管理股份有限公司关于在北京植信基金销售有限公司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	2021-06-26

## 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	20210531 - 20210630	24,246,506.49	28,221,125.25	24,246,506.49	28,221,125.25	47.22%
	2	20210101 - 20210303	47,300,074.52	0.00	47,300,074.52	0.00	0.00%
	3	20210101 - 20210303	47,300,074.52	0.00	47,300,074.52	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> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期末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恒益量化灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华恒益量化灵活配置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) 《新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（更新）
- (七) 《新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》（更新）
- (八) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (九) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (十) 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

二〇二一年八月二十七日