

# 新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

### 2023 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 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.....	5
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> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
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合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>47</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	48
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.9 其他重大事件 .....	50
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>52</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新华外延增长主题灵活配置混合
基金主代码	003238
交易代码	003238
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月2日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	87,205,321.92 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	重点关注国家产业升级发展过程中带来的投资机会，综合运用多种投资策略，精选外延增长主题的优质企业进行投资，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上，力争为投资人提供长期稳定的回报。
投资策略	投资策略方面，本基金将以大类资产配置策略为基础，采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。大类资产配置策略主要运用战略性资产配置策略和战术性资产配置策略。股票投资策略指通过对外延增长主题个股的持续跟踪，以研究员以及基金经理的实地调研、密切跟踪以及扎实的案头分析工作为基础，采用自上而下与自下而上相结合的选股策略，动态精选能够充分受益于外延增长为主题的优质股票进行投资。具体运作方法包括外延增长主题相关股票的界定和个股挖掘等方法。债券投资策略主要运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略等。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩
	联系电话	010-68779688
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn
客户服务电话	4008198866	021-60637228
传真	010-68779528	021-60635778

注册地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	400010	100033
法定代表人	于春玲	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）
本期已实现收益	-2,079,212.87
本期利润	-1,514,457.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0509
本期加权平均净值利润率	-2.55%
本期基金份额净值增长率	3.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	49,989,017.79
期末可供分配基金份额利润	0.5732
期末基金资产净值	137,194,339.71
期末基金份额净值	1.5732
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	96.75%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.98%	1.30%	0.51%	0.51%	-1.49%	0.79%
过去三个月	-4.52%	1.37%	-2.72%	0.47%	-1.80%	0.90%
过去六个月	3.40%	1.19%	0.45%	0.48%	2.95%	0.71%
过去一年	-16.52%	1.15%	-7.00%	0.56%	-9.52%	0.59%
过去三年	6.32%	1.48%	-1.24%	0.69%	7.56%	0.79%
自基金合同生效起至今	96.75%	1.48%	9.34%	0.71%	87.41%	0.77%

注：1、本基金于 2017 年 3 月 2 日基金合同生效；

2、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，债券投资部分的业绩比较基准选择中国债券总指数收益率，复合业绩比较基准为 60%×中证 800 指数收益率+40%×中国债券总指数收益率。

3、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

新华外延增长主题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 3 月 2 日至 2023 年 6 月 30 日）



注：本报告期，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2023 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十八只开放式基金，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、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、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、新华行业龙头主题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、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金。

#### 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		
张霖	本基金基金经理，新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。	2021-09-03	-	15	金融学硕士，历任长城证券研究所所长助理、新华基金管理股份有限公司基金经理助理、研究部总监。
邓岳	本基金基金经理，新华中证环保产业指数证券投资基金基金经理、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证	2023-06-29	-	15	信息与信号处理专业硕士，历任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员，国信证券股份有限公司量化研究员，光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理，盈融达投资（北京）有限公司投资经理。

	券投资基金基金经理、新华万银多元策略灵活配置混合型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基金经理、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。				
--	--	--	--	--	--

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》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4、本基金基金经理张霖于 2023 年 8 月 22 日离任。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年,市场先上后下, wind 全 A 涨幅仅 3.06%。前期受疫情放开及政策预期的推动, 市场有一波比较大的整体性上涨, 后期板块分化较大。受信创正常和 AIGC 的科技突破的催化, 通信、传媒、计算机行业指数涨幅都超过 30%, 遥遥领先其他行业, 而受制于经济数据持续走弱的影响, 与经济相关性较大的行业大多表现不佳, 消费者服务、地产、综合、农林牧渔等板块跌幅靠前。

本基金产品在上半年的操作也分 2 个阶段: 一是前期大幅增加了电子、计算机和传媒仓位, 重点布局数字经济赛道, 由于上半年这三个行业市场领先, 虽然后期向受系统性估值影响而有一定回撤, 但是上半年整体仍然贡献较多的正收益, 二是 5 到 6 月防守转进攻, 适度把握了通讯、机械等板块机会, 结构上适度做了 AI+顺周期扩散。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 1.5732 元, 本报告期份额净值增长率为 3.40%, 同期比较基准的增长率为 0.45%。

#### 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 2023 年下半年，我们对市场保持积极乐观态度，A 股整体呈现板块轮动上涨格局。因为：1) 政策发力效果落地叠加低基数，实体经济向好有望持续提振市场预期，库存周期有望回落至小周期底部，对 A 股形成支撑，稳经济政策陆续落地也有望推动相关板块走强，高端制造、传统制造、科技等板块有望获得更多实质性利好，带动市场活跃度上升。2) 海外层面，汇率方面，RMB 继续贬值空间有限。美联储加息对 A 股的负面影响显著下降，尽管美联储加息周期仍未停止，但市场普遍预计本轮加息周期已进入下半程，外部扰动影响的减弱也将助力内地股市市场信心进一步修复。

从估值角度看，更有吸引力。从估值角度看，截止 2023 年 6 月 30 日，万得全 A（非金融、石油石化）PE 为 28.65，处于 2010 年来 48.9%分位，处于历史中位；创业板指 PE 为 32.55，处于 2010 年来 5%分位，接近历史低位。我们认为前期市场的行情与 2013、2019 年类似，在经济数据环比修复接近尾声的阶段，进入了震荡区间，伴随着后期经济数据的逐步好转，市场有望第二轮的上行。

投资策略：结构均衡、把握轮动，关注 2 大方向。1) 从 AI 到 AI+，在泛科技制造领域寻找能出业绩具备较强核心竞争力的引领者，关注受国家政策支持积极进行创新研发投入，如，机器人、工业自动化+ai，无人驾驶产业链上的机械、电气设备等公司，或者，中报业绩较好的细分板块。政策端大力支持、产业端技术进步加快的推动下，下半年，以数字经济为代表的 TMT 板块行情有望进入业绩驱动阶段。我们预计 TMT 板块 23 年归母净利润同比增速有望达到 20+%左右，呈现边际好转迹象。且经过前期宽幅震荡估值得到部分消化，随着数字经济发展提速，公募基金或将持续增配 TMT 板块中相对低估品种。

2) 顺周期。展望下半年，政策有望发力，进一步稳定市场预期、优化消费环境，更大释放新能源汽车消费潜力；消费有望成为政策发力点。政策以大宗消费品为抓手，有望带动消费大盘的增长，股息率高且具备优质现金流的国央企在政策催化下仍有修复空间，值得逐步逢低配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值小组，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业

市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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，本基金共进行一次分红，于 2023 年 6 月 29 日（权益登记日），每 10 份分红 3.90 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金从 2023 年 01 月 13 日到 2023 年 4 月 12 日连续 58 个工作日以及从 2023 年 4 月 21 日到 2023 年 5 月 30 日连续 25 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	44,932,665.12	11,841,548.47
结算备付金		318,001.69	252,262.67
存出保证金		36,929.50	39,623.76
交易性金融资产	6.4.7.2	127,565,481.80	43,127,600.85
其中：股票投资		127,565,481.80	43,127,600.85
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,860,523.84	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,508.64	4,694.23
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		174,718,110.59	55,265,729.98
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,505,755.96	3,520,795.49
应付赎回款		16,599.75	20,843.58
应付管理人报酬		184,925.72	46,311.12
应付托管费		30,820.94	7,718.53
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		32,549,131.57	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,236,536.94	1,035,531.91
负债合计		37,523,770.88	4,631,200.63
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	87,205,321.92	26,610,631.28

其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	49,989,017.79	24,023,898.07
净资产合计		137,194,339.71	50,634,529.35
负债和净资产总计		174,718,110.59	55,265,729.98

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5732 元，基金份额 87,205,321.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-913,389.99</b>	<b>-5,422,277.12</b>
1.利息收入		26,360.17	27,320.17
其中：存款利息收入	6.4.7.9	26,360.17	17,695.30
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		-	9,624.87
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,637,405.33	-7,620,100.11
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,074,699.09	-7,748,381.28
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.15	437,293.76	128,281.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	564,754.96	1,955,946.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	132,900.21	214,556.14
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>601,067.92</b>	<b>433,491.09</b>
1. 管理人报酬		<b>438,590.88</b>	<b>320,202.69</b>
2. 托管费		73,098.47	53,367.05
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-

7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	89,378.57	59,921.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,514,457.91</b>	<b>-5,855,768.21</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,514,457.91</b>	<b>-5,855,768.21</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-1,514,457.91</b>	<b>-5,855,768.21</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	26,610,631.28	-	24,023,898.07	50,634,529.35
二、本期期初净资产（基金净值）	26,610,631.28	-	24,023,898.07	50,634,529.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	60,594,690.64	-	25,965,119.72	86,559,810.36
（一）、综合收益总额	-	-	-1,514,457.91	-1,514,457.91
（二）、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）	60,594,690.64	-	61,197,132.69	121,791,823.33
其中：1.基金申购款	71,058,609.69	-	71,046,613.86	142,105,223.55
2.基金赎回款	-10,463,919.05	-	-9,849,481.17	-20,313,400.22
（三）、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）	-	-	-33,717,555.06	-33,717,555.06



四、本期期末净资产（基金净值）	87,205,321.92	-	49,989,017.79	137,194,339.71
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	18,540,091.78	-	30,655,114.76	49,195,206.54
二、本期期初净资产（基金净值）	18,540,091.78	-	30,655,114.76	49,195,206.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-909,135.33	-	-6,731,520.00	-7,640,655.33
（一）、综合收益总额	-	-	-5,855,768.21	-5,855,768.21
（二）、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）	-909,135.33	-	-875,751.79	-1,784,887.12
其中：1.基金申购款	13,331,403.43	-	17,101,480.20	30,432,883.63
2.基金赎回款	-14,240,538.76	-	-17,977,231.99	-32,217,770.75
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	17,630,956.45	-	23,923,594.76	41,554,551.21

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：于春玲，主管会计工作负责人：于春玲，会计机构负责人：徐端寒

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

新华外延增长主题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[2016]1724 号文准予注册，由新华基金管理股份有限公司发起募集的契约型开放式基金，于 2017 年 1 月 23 日至 2 月 24 日向社会公开募集，首次募集资金总

额 432,690,734.09 元, 其中募集净认购资金金额 432,628,673.66 元, 募集资金产生利息 62,060.43 元, 并经瑞华会计师事务所有限公司瑞华验字[2017]第 01360008 号验资报告予以验证。2017 年 3 月 2 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, 本基金管理人为新华基金管理股份有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、债券 (包括国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、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、银行存款、现金及到期日在一年以内的政府债券等, 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)。本基金股票资产投资比例为基金资产的 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 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或者到期日在一年以内的政府债券, 投资于外延增长主题的证券资产不低于本基金非现金基金资产的 80%。本基金所指的外延增长主要指上市公司通过并购重组实现企业生产经营规模的迅速扩张和业务领域的多元化拓展, 所界定外延增长主题的股票为已经实施、正在进行外延增长或通过分析有外延增长预期的发行上市股票。

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 2023 年 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制, 根据实际发生的交易和事项, 按照财政部于 2006 年 2 月 15 日发布的《企业会计准则——基本准则》、及其后颁布和修订的 41 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 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

本基金本报告期采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 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

本基金报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期末发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期末发生差错更正。

#### 6.4.6 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 12 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。

#### 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	44,932,665.12
等于：本金	44,930,044.11
加：应计利息	2,621.01
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	44,932,665.12

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	128,461,000.50	-	127,565,481.80	-895,518.70
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	128,461,000.50	-	127,565,481.80	-895,518.70

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.26
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,152,693.52
其中：交易所市场	1,152,693.52
银行间市场	-
应付利息	-
账户维护费	4,500.00
中国证券报	39,671.58
审计费	39,671.58
合计	1,236,536.94

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,610,631.28	26,610,631.28
本期申购	71,058,609.69	71,058,609.69
本期赎回（以“-”号填列）	-10,463,919.05	-10,463,919.05
本期末	87,205,321.92	87,205,321.92

注：申购含红利再投资、转换转入份额，赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,218,320.54	-7,194,422.47	24,023,898.07
本期利润	-2,079,212.87	564,754.96	-1,514,457.91
本期基金份额交易产生的变动数	72,248,803.39	-11,051,670.70	61,197,132.69
其中：基金申购款	84,720,657.91	-13,674,044.05	71,046,613.86
基金赎回款	-12,471,854.52	2,622,373.35	-9,849,481.17
本期已分配利润	-33,717,555.06	-	-33,717,555.06
本期末	67,670,356.00	-17,681,338.21	49,989,017.79

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,462.93
其他	-
合计	26,360.17

注：结算备付金利息收入包括存出保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	221,893,705.20
减：卖出股票成本总额	223,300,963.07
减：交易费用	667,441.22
买卖股票差价收入	-2,074,699.09

#### 6.4.7.11 基金投资收益

报告期末，本基金无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

报告期末，本基金无债券投资收益。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

报告期末，本基金无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

报告期末，本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	437,293.76
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	437,293.76

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	564,754.96
——股票投资	564,754.96
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	564,754.96

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	132,848.37
补差费收入	51.84
合计	132,900.21

## 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	660.16
存托服务费	15.25
中国证券报	39,671.58
账户维护费	9,000.00
其他费用	360.00
合计	89,378.57

## 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 2023 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

本基金从 2023 年 8 月 21 日起，管理费率降至 1.20%，托管费率降至 0.20%。

#### 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
中国建设银行股份有限公司	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	348,212,887.11	65.83%	4,753,358.50	1.27%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	-	-	4,000,000.00	3.17%

注：本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

### 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 2023年1月1日至2023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	254,665.45	63.05%	250,754.67	21.75%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	3,476.08	1.20%	-	-

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的监管费和经手费后的净额列示。

2、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

3、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 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 2023年1月1日至2023年6月	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月
----	-------------------------	------------------------------

	30日	30日
当期发生的基金应支付的管理费	438,590.88	320,202.69
其中：支付销售机构的客户维护费	93,293.64	108,648.89

注：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,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	73,098.47	53,367.05

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期内,除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	44,932,665.12	23,897.24	5,380,952.08	14,766.75

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明****6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023-06-29	-	2023-06-29	3.900	32,549,131.57	1,168,423.49	33,717,555.06	-
合计				3.900	32,549,131.57	1,168,423.49	33,717,555.06	-

**6.4.12 期末（2023 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**

报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

报告期末，本基金无银行间市场债券正回购余额。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

报告期末，本基金无交易所市场债券正回购余额。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期期末未参与转融通证券出借业务。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

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

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	44,932,665.12	-	-	-	44,932,665.12
结算备付金	318,001.69	-	-	-	318,001.69
存出保证金	36,929.50	-	-	-	36,929.50
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	127,565,481.80	127,565,481.80

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收清算款	-	-	-	1,860,523.84	1,860,523.84
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	4,508.64	4,508.64
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	45,287,596.31	0.00	0.00	129,430,514.28	174,718,110.59
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付清算款	-	-	-	3,505,755.96	3,505,755.96
应付赎回款	-	-	-	16,599.75	16,599.75
应付管理人报酬	-	-	-	184,925.72	184,925.72
应付托管费	-	-	-	30,820.94	30,820.94
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	32,549,131.57	32,549,131.57
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	1,236,536.94	1,236,536.94
负债总计	0.00	0.00	0.00	37,523,770.88	37,523,770.88
利率敏感度缺口	45,287,596.31	0.00	0.00	91,906,743.40	137,194,339.71
上年度末 2022 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	11,841,548.47	-	-	-	11,841,548.47
结算备付金	252,262.67	-	-	-	252,262.67
存出保证金	39,623.76	-	-	-	39,623.76
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	43,127,600.85	43,127,600.85
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	4,694.23	4,694.23
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	12,133,434.90	0.00	0.00	43,132,295.08	55,265,729.98
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	3,520,795.49	3,520,795.49
应付赎回款	-	-	-	20,843.58	20,843.58
应付管理人报酬	-	-	-	46,311.12	46,311.12
应付托管费	-	-	-	7,718.53	7,718.53
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	1,035,531.91	1,035,531.91
负债总计	0.00	0.00	0.00	4,631,200.63	4,631,200.63
利率敏感度缺口	12,133,434.90	0.00	0.00	38,501,094.45	50,634,529.35

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

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



净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的资产与负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	127,565,481.80	92.98	43,127,600.85	85.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	127,565,481.80	92.98	43,127,600.85	85.17

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升或下降 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

	沪深 300 指数上升 1%	1,047,144.56	300,702.43
	沪深 300 指数下降 1%	-1,047,144.56	-300,702.43

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	127,565,481.80
第二层次	0.00
第三层次	0.00
合计	127,565,481.80

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价

值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	127,565,481.80	73.01
	其中：股票	127,565,481.80	73.01
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	45,250,666.81	25.90
8	其他各项资产	1,901,961.98	1.09
9	合计	174,718,110.59	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	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	70,589,050.85	51.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,700,847.80	7.80
F	批发和零售业	1,629,870.00	1.19
G	交通运输、仓储和邮政业	268,260.00	0.20
H	住宿和餐饮业	846,800.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,281,454.70	16.97
J	金融业	11,724,940.00	8.55
K	房地产业	2,762,873.00	2.01
L	租赁和商务服务业	646,149.50	0.47
M	科学研究和技术服务业	1,220,811.90	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,894,424.05	2.84
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	127,565,481.80	92.98

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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	002422	科伦药业	185,000	5,490,800.00	4.00
2	688111	金山办公	9,961	4,703,783.42	3.43
3	300827	上能电气	123,355	4,446,947.75	3.24
4	600872	中炬高新	87,001	3,200,766.79	2.33
5	601800	中国交建	279,200	3,046,072.00	2.22
6	000063	中兴通讯	63,600	2,896,344.00	2.11
7	002624	完美世界	164,200	2,773,338.00	2.02
8	003031	中瓷电子	20,300	2,702,336.00	1.97
9	600482	中国动力	108,120	2,534,332.80	1.85

10	300624	万兴科技	21,600	2,530,440.00	1.84
11	600150	中国船舶	75,600	2,487,996.00	1.81
12	688776	国光电气	29,536	2,447,943.68	1.78
13	600031	三一重工	145,800	2,424,654.00	1.77
14	688502	茂莱光学	12,441	2,388,672.00	1.74
15	600030	中信证券	116,700	2,308,326.00	1.68
16	002051	中工国际	191,960	2,290,082.80	1.67
17	002044	美年健康	311,700	2,216,187.00	1.62
18	603306	华懋科技	75,800	2,199,716.00	1.60
19	300351	永贵电器	121,400	1,994,602.00	1.45
20	002156	通富微电	86,600	1,957,160.00	1.43
21	600958	东方证券	200,000	1,940,000.00	1.41
22	300033	同花顺	11,000	1,928,080.00	1.41
23	002230	科大讯飞	26,400	1,794,144.00	1.31
24	300015	爱尔眼科	90,471	1,678,237.05	1.22
25	601318	中国平安	32,600	1,512,640.00	1.10
26	600325	华发股份	153,000	1,507,050.00	1.10
27	300059	东方财富	105,400	1,496,680.00	1.09
28	300724	捷佳伟创	13,000	1,460,550.00	1.06
29	300308	中际旭创	9,600	1,415,520.00	1.03
30	000651	格力电器	37,900	1,383,729.00	1.01
31	600511	国药股份	34,500	1,340,325.00	0.98
32	002415	海康威视	40,000	1,324,400.00	0.97
33	300274	阳光电源	11,000	1,282,930.00	0.94
34	601728	中国电信	226,700	1,276,321.00	0.93
35	300223	北京君正	14,000	1,236,340.00	0.90
36	300820	英杰电气	14,550	1,198,629.00	0.87
37	601611	中国核建	140,100	1,183,845.00	0.86
38	688400	凌云光	36,714	1,119,042.72	0.82
39	002777	久远银海	29,900	1,060,553.00	0.77
40	000928	中钢国际	108,900	1,050,885.00	0.77
41	300454	深信服	9,100	1,030,575.00	0.75
42	601138	工业富联	38,800	977,760.00	0.71
43	688012	中微公司	6,163	964,201.35	0.70
44	000938	紫光股份	30,000	955,500.00	0.70
45	300496	中科创达	9,600	924,960.00	0.67
46	601186	中国铁建	92,700	913,095.00	0.67
47	688032	禾迈股份	2,504	889,295.60	0.65
48	601066	中信建投	36,200	876,040.00	0.64
49	600536	中国软件	18,090	848,059.20	0.62
50	600754	锦江酒店	20,000	846,800.00	0.62
51	300866	安克创新	9,600	840,000.00	0.61
52	689009	九号公司	22,200	818,070.00	0.60
53	603018	华设集团	91,300	798,875.00	0.58

54	000002	万 科 A	56,000	785,120.00	0.57
55	002555	三七互娱	22,400	781,312.00	0.57
56	002920	德赛西威	5,000	779,050.00	0.57
57	601117	中国化学	94,000	778,320.00	0.57
58	002368	太极股份	18,900	778,113.00	0.57
59	603893	瑞芯微	10,600	772,210.00	0.56
60	002738	中矿资源	14,700	748,818.00	0.55
61	688009	中国通号	128,406	744,754.80	0.54
62	688301	奕瑞科技	2,599	734,035.57	0.54
63	002568	百润股份	20,000	727,000.00	0.53
64	000729	燕京啤酒	55,400	690,838.00	0.50
65	002508	老板电器	26,600	672,714.00	0.49
66	600050	中国联通	140,000	672,000.00	0.49
67	688521	芯原股份	9,060	651,595.20	0.47
68	300226	上海钢联	20,000	648,000.00	0.47
69	601360	三六零	50,000	627,000.00	0.46
70	300394	天孚通信	5,800	619,614.00	0.45
71	603589	口子窖	12,300	607,005.00	0.44
72	688023	安恒信息	3,464	605,195.44	0.44
73	300750	宁德时代	2,500	571,975.00	0.42
74	688390	固德威	3,215	536,454.90	0.39
75	000065	北方国际	35,300	530,206.00	0.39
76	603517	绝味食品	14,100	523,815.00	0.38
77	603019	中科曙光	10,000	509,000.00	0.37
78	688578	艾力斯	18,795	506,525.25	0.37
79	688981	中芯国际	10,000	505,200.00	0.37
80	002966	苏州银行	71,600	468,980.00	0.34
81	603345	安井食品	3,100	455,080.00	0.33
82	601077	渝农商行	125,200	449,468.00	0.33
83	600986	浙文互联	70,000	448,000.00	0.33
84	600585	海螺水泥	18,700	443,938.00	0.32
85	300058	蓝色光标	45,800	442,886.00	0.32
86	300166	东方国信	38,800	436,112.00	0.32
87	688072	拓荆科技	1,000	425,970.00	0.31
88	688131	皓元医药	7,405	421,936.90	0.31
89	300832	新产业	7,100	418,900.00	0.31
90	688039	当虹科技	11,556	414,167.04	0.30
91	601890	亚星锚链	34,700	401,826.00	0.29
92	600248	陕西建工	84,000	400,680.00	0.29
93	600298	安琪酵母	10,500	380,205.00	0.28
94	688036	传音控股	2,542	373,674.00	0.27
95	688630	芯碁微装	4,120	346,162.40	0.25
96	601668	中国建筑	60,000	344,400.00	0.25
97	000333	美的集团	5,800	341,736.00	0.25

98	601998	中信银行	54,600	326,508.00	0.24
99	000831	中国稀土	11,000	325,600.00	0.24
100	688076	诺泰生物	8,563	304,671.54	0.22
101	603883	老百姓	9,700	289,545.00	0.21
102	601816	京沪高铁	51,000	268,260.00	0.20
103	688080	映翰通	5,387	263,424.30	0.19
104	300638	广和通	10,000	226,800.00	0.17
105	688617	惠泰医疗	600	224,250.00	0.16
106	002223	鱼跃医疗	5,500	197,945.00	0.14
107	688256	寒武纪	1,046	196,648.00	0.14
108	605168	三人行	2,175	186,919.50	0.14
109	688772	珠海冠宇	8,600	173,290.00	0.13
110	601577	长沙银行	21,900	169,944.00	0.12
111	605589	圣泉集团	7,800	169,572.00	0.12
112	002384	东山精密	6,500	168,350.00	0.12
113	002050	三花智控	5,500	166,430.00	0.12
114	688800	瑞可达	2,669	165,878.35	0.12
115	002081	金螳螂	36,200	163,262.00	0.12
116	600685	中船防务	5,300	158,735.00	0.12
117	000031	大悦城	42,400	155,184.00	0.11
118	600048	保利发展	11,900	155,057.00	0.11
119	601336	新华保险	4,200	154,434.00	0.11
120	300003	乐普医疗	6,800	153,748.00	0.11
121	600383	金地集团	20,200	145,642.00	0.11
122	600521	华海药业	7,900	145,439.00	0.11
123	600398	海澜之家	20,000	137,600.00	0.10
124	600085	同仁堂	2,000	115,120.00	0.08
125	688331	荣昌生物	1,840	102,580.00	0.07
126	688017	绿的谐波	630	102,312.00	0.07
127	000768	中航西飞	3,700	98,975.00	0.07
128	601988	中国银行	24,000	93,840.00	0.07
129	688083	中望软件	560	81,138.40	0.06
130	688120	华海清科	301	75,867.05	0.06
131	000423	东阿阿胶	1,300	69,485.00	0.05
132	002881	美格智能	1,000	34,150.00	0.02
133	600372	中航电子	1,100	16,698.00	0.01
134	002027	分众传媒	2,400	16,344.00	0.01
135	002340	格林美	2,300	15,893.00	0.01
136	603596	伯特利	200	15,852.00	0.01
137	600376	首开股份	3,800	14,820.00	0.01
138	002372	伟星新材	700	14,378.00	0.01
139	603676	卫信康	1,000	13,820.00	0.01
140	600529	山东药玻	500	13,610.00	0.01
141	000739	普洛药业	700	12,418.00	0.01

142	300476	胜宏科技	400	9,644.00	0.01
143	002475	立讯精密	200	6,490.00	0.00
144	601989	中国重工	1,000	4,820.00	0.00
145	300699	光威复材	100	3,085.00	0.00
146	688223	晶科能源	200	2,812.00	0.00
147	600060	海信视像	100	2,475.00	0.00
148	002463	沪电股份	100	2,094.00	0.00

#### 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	688111	金山办公	6,107,401.44	12.06
2	002422	科伦药业	5,501,837.00	10.87
3	300418	昆仑万维	5,492,586.00	10.85
4	300827	上能电气	5,420,699.00	10.71
5	688502	茂莱光学	4,899,793.81	9.68
6	688131	皓元医药	4,830,723.27	9.54
7	600872	中炬高新	4,417,182.00	8.72
8	601360	三六零	4,250,204.00	8.39
9	002415	海康威视	4,145,408.00	8.19
10	300033	同花顺	3,889,887.00	7.68
11	688041	海光信息	3,837,037.78	7.58
12	688012	中微公司	3,739,570.18	7.39
13	600150	中国船舶	3,704,343.00	7.32
14	600958	东方证券	3,623,432.00	7.16
15	002624	完美世界	3,561,638.00	7.03
16	600031	三一重工	3,390,788.00	6.70
17	300624	万兴科技	3,339,088.00	6.59
18	601800	中国交建	3,328,659.00	6.57
19	603893	瑞芯微	3,309,569.00	6.54
20	600030	中信证券	3,294,952.00	6.51
21	002230	科大讯飞	3,274,998.00	6.47
22	603306	华懋科技	3,235,052.00	6.39
23	002051	中工国际	3,131,823.20	6.19
24	000063	中兴通讯	2,865,046.21	5.66
25	601138	工业富联	2,860,526.00	5.65
26	300168	万达信息	2,815,228.00	5.56
27	688776	国光电气	2,764,508.96	5.46
28	003031	中瓷电子	2,761,650.00	5.45



29	603806	福斯特	2,582,186.00	5.10
30	300015	爱尔眼科	2,555,798.00	5.05
31	600482	中国动力	2,531,570.00	5.00
32	688521	芯原股份	2,486,768.53	4.91
33	002821	凯莱英	2,484,961.00	4.91
34	300059	东方财富	2,434,020.00	4.81
35	300724	捷佳伟创	2,389,996.00	4.72
36	688256	寒武纪	2,365,842.82	4.67
37	600588	用友网络	2,344,060.00	4.63
38	688498	源杰科技	2,339,169.78	4.62
39	002920	德赛西威	2,320,653.00	4.58
40	002568	百润股份	2,300,627.00	4.54
41	600536	中国软件	2,246,965.00	4.44
42	000651	格力电器	2,242,084.00	4.43
43	300750	宁德时代	2,226,574.00	4.40
44	002044	美年健康	2,185,282.00	4.32
45	000938	紫光股份	2,178,870.00	4.30
46	002156	通富微电	2,141,336.00	4.23
47	601318	中国平安	2,074,300.00	4.10
48	688981	中芯国际	2,042,856.52	4.03
49	300274	阳光电源	2,020,637.00	3.99
50	300351	永贵电器	2,010,011.00	3.97
51	688031	星环科技	2,003,046.60	3.96
52	688258	卓易信息	1,964,963.60	3.88
53	601728	中国电信	1,951,343.00	3.85
54	300229	拓尔思	1,935,246.00	3.82
55	688036	传音控股	1,928,872.20	3.81
56	600986	浙文互联	1,911,821.00	3.78
57	300454	深信服	1,877,852.00	3.71
58	300223	北京君正	1,861,193.00	3.68
59	688311	盟升电子	1,824,200.49	3.60
60	300820	英杰电气	1,698,889.00	3.36
61	601611	中国核建	1,623,727.00	3.21
62	600754	锦江酒店	1,617,902.00	3.20
63	600325	华发股份	1,609,002.00	3.18
64	603259	药明康德	1,607,465.00	3.17
65	688008	澜起科技	1,593,539.90	3.15
66	688375	国博电子	1,528,348.85	3.02
67	000776	广发证券	1,491,169.00	2.94
68	688270	臻镭科技	1,487,393.77	2.94
69	300502	新易盛	1,467,910.00	2.90
70	002555	三七互娱	1,455,489.00	2.87
71	000988	华工科技	1,441,701.00	2.85
72	603986	兆易创新	1,438,789.00	2.84

73	000002	万 科 A	1,394,800.00	2.75
74	300499	高澜股份	1,352,752.00	2.67
75	000928	中钢国际	1,344,915.00	2.66
76	688037	芯源微	1,321,610.00	2.61
77	002049	紫光国微	1,312,096.00	2.59
78	600511	国药股份	1,281,980.00	2.53
79	688400	凌云光	1,271,459.62	2.51
80	601066	中信建投	1,266,604.00	2.50
81	688348	昱能科技	1,254,646.24	2.48
82	002368	太极股份	1,231,554.00	2.43
83	002410	广联达	1,226,820.00	2.42
84	601186	中国铁建	1,209,052.00	2.39
85	300496	中科创达	1,188,988.00	2.35
86	688072	拓荆科技	1,186,195.66	2.34
87	301073	君亭酒店	1,170,738.00	2.31
88	605117	德业股份	1,166,365.00	2.30
89	600690	海尔智家	1,160,929.00	2.29
90	688331	荣昌生物	1,144,746.30	2.26
91	688200	华峰测控	1,132,186.76	2.24
92	000933	神火股份	1,120,100.00	2.21
93	300661	圣邦股份	1,114,280.00	2.20
94	300394	天孚通信	1,106,410.00	2.19
95	002777	久远银海	1,098,340.00	2.17
96	688202	美迪西	1,095,914.73	2.16
97	688039	当虹科技	1,079,152.99	2.13
98	688777	中控技术	1,053,254.77	2.08
99	600050	中国联通	1,045,020.00	2.06
100	603589	口子窖	1,041,539.00	2.06
101	300226	上海钢联	1,021,608.00	2.02

注：本项“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	300418	昆仑万维	5,423,491.10	10.71
2	688131	皓元医药	4,003,351.69	7.91
3	688041	海光信息	3,870,489.00	7.64
4	600536	中国软件	3,636,182.00	7.18
5	601360	三六零	3,365,900.00	6.65
6	688111	金山办公	3,242,029.36	6.40

7	688012	中微公司	3,032,031.32	5.99
8	688311	盟升电子	2,954,477.57	5.83
9	300168	万达信息	2,764,578.00	5.46
10	688258	卓易信息	2,692,328.96	5.32
11	002415	海康威视	2,605,981.00	5.15
12	603806	福斯特	2,524,866.00	4.99
13	603893	瑞芯微	2,460,523.00	4.86
14	688502	茂莱光学	2,300,534.25	4.54
15	688498	源杰科技	2,280,750.00	4.50
16	600588	用友网络	2,279,948.00	4.50
17	688256	寒武纪	2,223,384.50	4.39
18	002821	凯莱英	2,145,181.00	4.24
19	688031	星环科技	2,128,842.64	4.20
20	300763	锦浪科技	2,128,149.00	4.20
21	601138	工业富联	2,054,168.00	4.06
22	300229	拓尔思	2,054,097.00	4.06
23	600872	中炬高新	2,034,551.60	4.02
24	300033	同花顺	1,908,549.00	3.77
25	600958	东方证券	1,837,498.00	3.63
26	002955	鸿合科技	1,807,410.00	3.57
27	002920	德赛西威	1,746,200.00	3.45
28	300750	宁德时代	1,688,487.00	3.33
29	002568	百润股份	1,671,629.00	3.30
30	688521	芯原股份	1,645,275.70	3.25
31	688008	澜起科技	1,639,322.85	3.24
32	300454	深信服	1,605,537.00	3.17
33	688036	传音控股	1,595,256.00	3.15
34	002230	科大讯飞	1,585,975.00	3.13
35	688981	中芯国际	1,548,019.04	3.06
36	300502	新易盛	1,540,330.00	3.04
37	688375	国博电子	1,500,252.49	2.96
38	688270	臻镭科技	1,498,085.00	2.96
39	688348	昱能科技	1,493,384.54	2.95
40	000988	华工科技	1,493,088.00	2.95
41	603259	药明康德	1,461,192.00	2.89
42	603986	兆易创新	1,456,000.00	2.88
43	000776	广发证券	1,436,455.00	2.84
44	002371	北方华创	1,420,475.00	2.81
45	300850	新强联	1,387,002.00	2.74
46	600986	浙文互联	1,372,608.00	2.71
47	603345	安井食品	1,360,275.00	2.69
48	300499	高澜股份	1,348,378.00	2.66
49	600150	中国船舶	1,337,495.00	2.64
50	688037	芯源微	1,335,076.00	2.64

51	601800	中国交建	1,320,601.00	2.61
52	002049	紫光国微	1,320,533.00	2.61
53	002051	中工国际	1,302,032.00	2.57
54	600276	恒瑞医药	1,275,372.00	2.52
55	002607	中公教育	1,228,470.00	2.43
56	000938	紫光股份	1,225,550.00	2.42
57	301073	君亭酒店	1,212,194.00	2.39
58	301269	华大九天	1,181,280.00	2.33
59	688083	中望软件	1,172,201.59	2.32
60	300598	诚迈科技	1,165,928.00	2.30
61	688107	安路科技	1,158,729.44	2.29
62	300896	爱美客	1,158,224.00	2.29
63	605117	德业股份	1,153,854.00	2.28
64	000858	五粮液	1,145,740.00	2.26
65	300724	捷佳伟创	1,130,555.00	2.23
66	000933	神火股份	1,115,065.00	2.20
67	688200	华峰测控	1,110,912.75	2.19
68	601788	光大证券	1,082,512.00	2.14
69	300661	圣邦股份	1,075,483.00	2.12
70	300827	上能电气	1,070,334.00	2.11
71	600031	三一重工	1,063,605.00	2.10
72	688777	中控技术	1,058,089.74	2.09
73	603589	口子窖	1,052,120.00	2.08
74	300760	迈瑞医疗	1,047,362.00	2.07
75	601933	永辉超市	1,042,788.00	2.06
76	300474	景嘉微	1,035,117.40	2.04
77	600690	海尔智家	1,031,659.00	2.04
78	601668	中国建筑	1,028,533.00	2.03

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

#### 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	307,174,089.06
卖出股票的收入（成交）总额	221,893,705.20

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期末本基金投资的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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，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	36,929.50
2	应收清算款	1,860,523.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,508.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,901,961.98

#### 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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,597	54,605.71	69,496,344.69	79.69%	17,708,977.23	20.31%

**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	413,470.40	0.47%

**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	10~50

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2017年3月2日）基金份额总额	432,690,734.09
本报告期期初基金份额总额	26,610,631.28
本报告期基金总申购份额	71,058,609.69
减：本报告期基金总赎回份额	10,463,919.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	87,205,321.92

**10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

2023年2月28日，翟晨曦女士离任公司董事长，于春玲女士代任公司董事长，刘征宇先生由于个人原因不再担任副总经理。2023年3月23日，崔凤廷先生担任公司副总经理。2023年4月，公司法定代表人变更为于春玲女士。2023年6月28日，于春玲女士担任公司董事长、代任总经理，张宗友先生离任公司联席董事长，崔凤廷先生担任公司董事会秘书。

本报告期因第二届董事会任期届满，经公司2023年第二次股东大会审议通过，选举于春玲女士、张宗友先生、李磊先生、匡双礼先生、张坤女士、徐经长先生担任公司第三届董事会董事，其中匡

双礼先生、张坤女士、徐经长先生为独立董事。卢东亮先生担任非职工监事，王建岭先生、孙义女士担任职工监事。2023 年 7 月 20 日，卢东亮先生担任监事会主席。

本报告期基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人与原深圳办公区所租房屋的房东黄淑娴与二房东（承租人）之间存在房屋占用费的纠纷案件，该案件二审判决作出，管理人需支付房屋使用费，二房东收取的房租应当退回。基金管理人专户产品众富 1 号交易对手湖北蕲春农商行对公司发起诉讼，目前该案件已申请撤诉。

本报告期未有涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期未有基金投资策略的改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
恒泰证券	2	348,212,887.11	65.83%	254,665.45	63.05%	-
国信证券	1	73,838,200.40	13.96%	68,765.79	17.02%	-
安信证券	2	40,707,038.00	7.70%	29,769.17	7.37%	-
中信建投	1	39,634,823.94	7.49%	28,984.57	7.18%	-
国金证券	1	11,019,466.57	2.08%	10,262.35	2.54%	-
华创证券	1	8,014,212.19	1.52%	5,860.77	1.45%	-
太平洋证券	2	7,004,780.00	1.32%	5,122.66	1.27%	-
银河证券	1	529,094.00	0.10%	492.72	0.12%	-



方正证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	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 20 个交易席位，其中报告期内新增 0 个交易席位，退租 2 个交易席位。退租席位为：大同证券上海席位、大同证券深圳席位。

#### 一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

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

#### 二、交易席位的选择流程

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

#### 三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

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

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

- 3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

## 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旗下全部基金 2022 年 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	2023-01-20
2	新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-01-20
3	新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-02-08
4	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台及网上直销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	2023-02-15
5	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华瑞保险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	2023-02-21

6	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	2023-03-02
7	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	2023-03-02
8	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	2023-03-24
9	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加济安财富（北京）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	2023-03-27
10	新华基金管理股份有限公司旗下基金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	2023-03-30
11	新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2023-03-30
12	新华外延增长主题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	2023-04-12
13	新华外延增长主题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	2023-04-12
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金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	2023-04-21
15	新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-04-21
16	新华基金管理股份有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-04-25
17	新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资暂停大额申购公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-06
18	新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金分红公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-28
19	新华基金管理股份有限公司新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
20	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-06-29
21	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购、定期定额投资业务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	2023-06-30
22	新华基金管理股份有限公司关于公司董事变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
23	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	2023-06-30
24	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管	中国证券报、公司网站、	2023-06-30

	理人员变更公告	电子信披网站	
25	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	2023-06-30

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101 - 20230112	9,038,175.24	-	9,038,175.24	0.00	0.00%
	2	20230413 - 20230630	-	30,697,044.61	-	30,697,044.61	35.20%
	3	20230605 - 20230630	-	20,061,691.24	-	20,061,691.24	23.01%

#### 产品特有风险

本基金投资于股指期货，因此存在因投资股指期货而带来的风险：

(1) 基差风险：在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。

(2) 系统性风险：组合现货的 $\beta$ 可能不足或者过高，组合风险敞口过大，股指期货空头头寸不能完全对冲现货的风险，组合存在系统性暴露的风险。

(3) 保证金风险：产品的期货头寸，如果未预留足够现金，在市场出现极端情况时，可能遭遇保证金不足而被强制平仓的风险。

(4) 合约展期风险：组合持有的主力合约交割日临近，需要更换合约进行展期，如果合约的基差不利或流动性不足，展期会面临风险。

本基金投资于可转换债券，可转换债券的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，对这些条款研究不足导致的事件可能为本基金带来损失。例如，当可转换债券的价格明显高于其赎回价格时，若本基金未能在可转换债券被赎回前转股或卖出，则可能产生不必要的损失。

本基金投资于中小企业私募债券所面临的信用风险及流动性风险。信用风险主要是由目前国内中小企业的发展状况所导致的发行人违约、不按时偿付本金或利息的风险；流动性风险主要是由债券非公开发行和转让所导致的无法按照合理的价格及时变现的风险。由于中小企业私募债券的特殊性，本基金的总体风险将有所提高。

本基金在选择投资标的时，将充分考虑上述风险给投资者带来的不利影响，在投资比例和标的选择上进行严格的风险控制，最大程度降低投资中小企业私募债券对本基金整体运作的影响。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续

信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华外延增长主题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) 《新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（更新）
- (七) 《新华外延增长主题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

二〇二三年八月三十日