

新华沪深 300 指数增强型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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：二〇二四年七月十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2024 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华沪深 300 指数增强
基金主代码	005248
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 18 日
报告期末基金份额总额	102,703,018.54 份
投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强基金，股票投资比例为基金资产的 80%以上，因此主要资产配置为股票资产，可少量投资于合同约定的其他资产类别。在保证

	股票投资比例符合合同要求的基础上，结合风险、流动性、基金申购赎回、分红等因素，对其他各类可投资资产类别的配置进行微调。本基金股票投资策略以指数化被动投资策略为基础策略，结合量化的选股模型、风险控制模型、流动性控制模型而形成综合的量化指数增强策略体系。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%。	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
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	
下属分级基金的基金简称	新华沪深 300 指数增强 A	新华沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005248	008184
报告期末下属分级基金的份额总额	81,893,380.81 份	20,809,637.73 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	新华沪深 300 指数增	新华沪深 300 指数增

	强 A	强 C
1.本期已实现收益	4,083,619.31	1,042,250.29
2.本期利润	-162,831.24	80,859.83
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0021	0.0042
4.期末基金资产净值	91,167,976.03	22,850,496.14
5.期末基金份额净值	1.1133	1.0981

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

新华沪深 300 指数增强 A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.41%	0.68%	-2.03%	0.72%	2.44%	-0.04%
过去六个月	4.74%	0.81%	0.88%	0.85%	3.86%	-0.04%
过去一年	-4.00%	0.78%	-9.38%	0.83%	5.38%	-0.05%
过去三年	-25.25%	0.96%	-32.19%	0.99%	6.94%	-0.03%
自基金合同生效起至今	11.33%	1.07%	-13.31%	1.11%	24.64%	-0.04%

新华沪深 300 指数增强 C

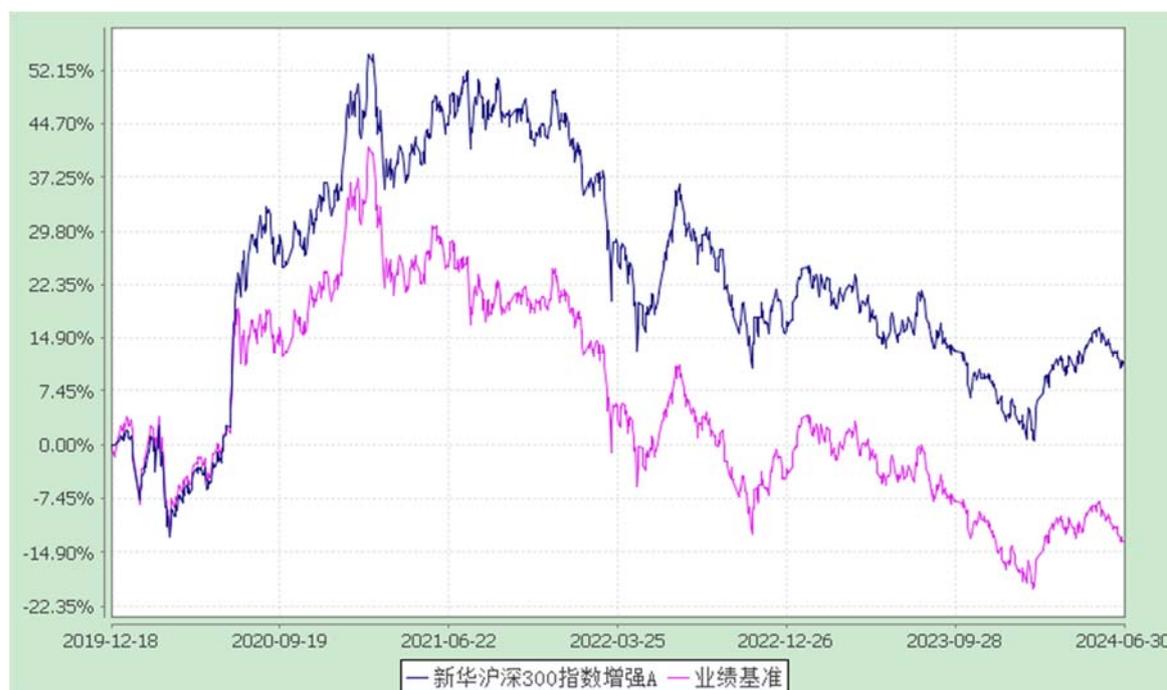
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.34%	0.68%	-2.03%	0.72%	2.37%	-0.04%

过去六个月	4.58%	0.81%	0.88%	0.85%	3.70%	-0.04%
过去一年	-4.30%	0.78%	-9.38%	0.83%	5.08%	-0.05%
过去三年	-25.93%	0.96%	-32.19%	0.99%	6.26%	-0.03%
自基金合同生效起至今	9.81%	1.07%	-13.31%	1.11%	23.12%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

新华沪深 300 指数增强型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2019 年 12 月 18 日至 2024 年 6 月 30 日)

新华沪深 300 指数增强 A



新华沪深 300 指数增强 C



注：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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓岳	本基金基金经理，新华中证环保产业指数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、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2019-12-18	-	16	信息与信号处理专业硕士，曾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。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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。

4.1.1 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

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华沪深 300 指数增强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》、《新华沪深 300 指数增强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 公平交易专项说明

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办法》，以避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。该办法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

公司通过合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，使各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”作为交易执行的公平原则，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。

本报告期内，公平交易管理执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现

重大异常情况，且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年 2 季度，市场先涨后跌，呈倒 V 字形走势。整体市场偏大盘风格，沪深 300 指数下跌较少，偏小微盘的中证 1000、中证 2000 指数跌幅都在 10% 以上。风格上，中证红利指数为代表的红利风格领先沪深 300 等宽基指数。行业层面，更是冰火两重天，2 季度多数行业表现较差，30 个中信行业中，除银行、电力及公用事业、交通运输、煤炭、电子指数涨幅为正，其他行业都是负收益，表现较差的行业为综合、消费者服务、传媒、商贸零售，跌幅都在 15% 以上。可以看到，表现较好的行业多数都有红利或防御的属性，与整体市场下跌的市况是匹配的。2 季度经济数据仍然不够好，中美利差依然较大，北上资金单季度流出近 300 亿。2 季度虽然包括地产放松政策在内的稳经济政策依然力度很强，但是资金呈流出状态，成交量低迷，股市上涨动力不足，仍然是难涨易跌的状态。市场仍然在期待更好的政策变化、更好的经济数据、更好的外部环境。

展望未来，过去很长一段时间已经出台了非常多的政策了，政策力度不可谓不强，经济能否企稳回升，很大程度上决定于政策能否真正落到实处；美联储加息已经到顶，实际上已经很久没有提高利率了，今年下半年有很大概率会进入降息周期，对外资流出压力会有一定的缓解，甚至可能反向流回 A 股，成为资金的增量。当前处于一个大国竞争、全球经济处于困境、地区冲突增多的时代，市场的影响因素极其复杂。下半年股市的决定因素在经济和资金，经济和资金的核心在国家政策对经济的实际拉动作用、美联储降息的落地节奏及其他外部环境的变化。结合当前市场点位不高，一季度在极端市况下已经调整较深，对后续走势向下的空间并没有那么悲观。

本基金为指数增强基金，标的指数为沪深 300 指数，投资目标为在有效控制跟踪误差的基础上，争取获得超过标的指数的收益。

2024 年 2 季度，指数增强主要采用量化选股的投资策略。其中量化选股策略主要基于多因子模型，综合采用估值、成长等多个大类的因子构建模型，整体

模型符合 A 股市场的长期投资逻辑。

2024 年 2 季度累计实现净值收益率 0.41%（A 类份额），同期沪深 300 指数收益率-2.14%，相对指数超额收益 2.55%，同期业绩比较基准收益-2.03%，相对业绩比较基准超额收益 2.44%；2 季度年化跟踪误差 3.56%，跟踪误差符合基金合同。当前，已经连续 5 个季度实现了正超额收益，相信基本面数据仍然会是影响股价的最重要的因素，我们基于基本面数据的量化策略会继续有比较好的表现。

未来本基金将不断优化量化选股模型，争取在维持与指数较小的跟踪误差的同时，获得超过指数的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.1133 元，本报告期份额净值增长率为 0.41%，同期比较基准的增长率为-2.03%；C 类份额净值为 1.0981 元，本报告期份额净值增长率为 0.34%，同期比较基准的增长率为-2.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	107,631,509.20	92.77
	其中：股票	107,631,509.20	92.77
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,331,333.24	7.18
7	其他资产	57,409.90	0.05
8	合计	116,020,252.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	987,438.00	0.87
C	制造业	8,964,488.72	7.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,926,162.00	1.69
E	建筑业	1,103,172.00	0.97
F	批发和零售业	369,705.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	978,354.00	0.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,100,169.08	0.96
J	金融业	-	-
K	房地产业	765,810.00	0.67
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	16,195,298.80	14.20

5.2.1.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,765,265.00	5.06
C	制造业	46,527,990.85	40.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,377,314.00	2.09
E	建筑业	2,532,400.00	2.22
F	批发和零售业	313,404.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	3,096,484.00	2.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,151,048.48	2.76
J	金融业	25,494,952.07	22.36
K	房地产业	264,579.00	0.23
L	租赁和商务服务业	866,400.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	1,046,373.00	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	91,436,210.40	80.19

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金无港股通股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,000	5,869,560.00	5.15
2	601318	中国平安	95,113	3,933,873.68	3.45
3	300750	宁德时代	17,940	3,229,738.20	2.83
4	000651	格力电器	57,190	2,242,991.80	1.97
5	600036	招商银行	62,535	2,138,071.65	1.88
6	601288	农业银行	455,000	1,983,800.00	1.74
7	601899	紫金矿业	104,500	1,836,065.00	1.61
8	601919	中远海控	117,400	1,818,526.00	1.59
9	600941	中国移动	16,700	1,795,250.00	1.57
10	601225	陕西煤业	68,800	1,772,976.00	1.55

5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603393	新天然气	33,200.00	1,153,368.00	1.01
2	600667	太极实业	193,200.00	1,103,172.00	0.97
3	600737	中粮糖业	113,100.00	1,084,629.00	0.95
4	688138	清溢光电	49,868.00	1,072,162.00	0.94
5	688289	圣湘生物	57,246.00	1,006,384.68	0.88

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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

本报告期末本基金无贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末，本基金尚无国债期货投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监管总局深圳监管局的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

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的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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

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

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,636.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	44,773.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,409.90

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华沪深300指数增 强A	新华沪深300指数增 强C
报告期期初基金份额总额	71,716,731.52	20,398,842.20
报告期期间基金总申购份额	11,161,763.92	5,494,976.89
减：报告期期间基金总赎回份额	985,114.63	5,084,181.36
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	81,893,380.81	20,809,637.73

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20240401-20240630	23,015,958.26	-	-	23,015,958.26	22.41%
	2	20240401-20240630	22,985,978.09	-	-	22,985,978.09	22.38%
产品特有风险							
(1) 标的指数收益率与股票市场平均收益率偏离的风险							

沪深300指数是由中证指数有限公司编制的反映A股市场整体走势的指数，该指数从上海和深圳证券交易所中选取300只交易活跃、代表性强的A股作为成份股，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强且公信力较好的股票指数，但并不能完全代表整个股票市场。所以，标的指数的收益率与整个股票市场的平均收益率可能存在偏离。

(2) 标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、股流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(4) 主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。调整投资组合的决策存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

(5) 股指期货投资风险

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 β 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。

(6) 资产支持证券投资风险

本基金投资于资产支持证券，与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

(7) 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。

(8) 本基金投资于非公开发行股票等流通受限证券。流通受限证券指由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，具有一定的流动性风险、法律风险、道德风险和操作风险等各种风险。基金管理人将制订严格的投资决策流程和风险控制制度及相关流动性风险处置预案。请基金份额持有人关注包括投资流通受限证可能导致的流动性风险、法律风险、道德风险和操作风险在内的各项风险。

(9) 基金参与融资业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资业务特有风险。

(10) 本基金投资于存托凭证的风险

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，可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末未有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录**9.1 备查文件目录**

- (一) 中国证监会批准新华沪深 300 指数增强型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华沪深 300 指数增强型证券投资基金之法律意见书
- (三) 《新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》
- (四) 《新华沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》
- (五) 《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (六) 更新的《新华沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- (七) 《新华沪深 300 指数增强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) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 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

二〇二四年七月十八日