

新华红利回报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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	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
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	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
5 托管人报告	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
6 半年度财务会计报告（未经审计）	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
7 投资组合报告	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
8 基金份额持有人信息	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
9 开放式基金份额变动	80
10 重大事件揭示	81
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
11 影响投资者决策的其他重要信息	84
12 备查文件目录	84
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	新华红利回报混合型证券投资基金
基金简称	新华红利回报混合
基金主代码	003025
交易代码	003025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月27日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	717,393,948.78 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	郭明
	联系电话	010-68779688	010-66105799
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95588
传真		010-68779528	010-66105798
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街55 号

办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号楼19层，北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	400010	100140
法定代表人	翟晨曦	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	27,592,199.05
本期利润	12,532,220.03
加权平均基金份额本期利润	0.0251
本期加权平均净值利润率	2.23%
本期基金份额净值增长率	2.47%
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	102,415,751.39
期末可供分配基金份额利润	0.1428
期末基金资产净值	819,809,700.17
期末基金份额净值	1.1428
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	76.83%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去 1 个月	-0.49%	0.15%	-1.08%	0.41%	0.59%	-0.26%
过去三个月	2.71%	0.26%	2.03%	0.49%	0.68%	-0.23%
过去六个月	2.47%	0.31%	0.50%	0.66%	1.97%	-0.35%
过去一年	12.09%	0.36%	12.21%	0.66%	-0.12%	-0.30%
过去三年	75.70%	0.75%	26.85%	0.67%	48.85%	0.08%
自基金合同生效起至今	76.83%	0.66%	27.75%	0.61%	49.08%	0.05%

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

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华红利回报混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2017 年 3 月 27 日至 2021 年 6 月 30 日）



注：本报告期末,本基金各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 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		
姚秋	本基金基金经理，新华基金总经理助理、平衡投资部总监、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理	2017-03-27	-	11	经济学博士、注册金融分析师，历任中国建设银行北京分行投资银行部投资研究工作、中国工商银行资产管理部固定收益投资经理。

	理。				
张乃先	本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、	2020-06-03	-	6	经济学硕士，历任新华基金固定收益信用研究员、宏观研究员、高级宏观研究员。

	新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理。				
于航	本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利	2020-06-03	-	6	统计学硕士，历任新华基金股票交易员，固定收益与平衡投资部研究员，从事宏观研究、策略研究、信用研究、转债研究等多个方向研究工作。

	灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理。				
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

2021 年上半年，国内疫情控制得当，出口和地产表现出较强的韧性，制造业投资有一定回升，基建明显走弱。总体来看，经济增长动能有走弱趋势，货币环境呈现偏宽松态势。

一季度，股票市场和债券市场都有明显调整，经历了估值消化后，部分增量资金敢于入场，二季度股票市场和债券市场表现均较好。我们整体上维持股票的持仓水平和债券的久期水平，没有对总敞口进行明显调节。股票方面，我们根据观察池中标的的估值水平变化的对比情况，适度进行了持仓结构调整。减配的标的主要集中在食品饮料、医药、工程机械、非银金融、家电等行业，增配的标的主要集中在化工、地产等短期热度不高的行业和汽车零部件等估值较为合理但未来盈利增长确定性较高的行业。整体持仓结构中，行业配置力度上较为均匀。债券方面，我们维持中短久期，以票息策略为主，坚持高等级无瑕疵的选债标准，严格防范潜在信用风险；我们维持一定比例的债性转债的持仓水平，其中主要以银行转债为主。

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 1.1428 元，本报告期份额净值增长率为 2.47%，同期比较基准的增长率为 0.50%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济显现出一定的边际走弱迹象，消费恢复进程缓慢，基建、地产增速边际下行。7 月份，央行进行了一次准备金率的普遍下调，市场将其解读为货币政策边际放松的信号。一方面，受出口数据持续超预期的影响，经济虽有走弱但稳增长压力不大；另一方面，疫情导致的经济 K 型复苏，使得不同微观主体之间的财富差距有所拉大。在此情况下，政策并不急于用强力措施托举经济增长，但以小微企业为代表的资金来源较为脆弱的经营主体，在后疫情时代举步维艰，需要得到政策的呵护。因此，政府在制定政策时，需要兼顾稳增长与调结构两个目标，而“宽货币、结构性紧信用”应该是当下的最优选择，在宏观环境没有大的变化的前提下，这个基调也有望保持。

股票市场整体估值水平较二季度进一步下行，但结构性分化的现象仍在进一步愈演愈烈。以新能源、半导体、军工为代表的少数行业，估值水平不断抬升，在增量资金有限的情况下，市场呈现此消彼长，其余多数行业走势疲弱。这几个优势行业的共同之处，除增速较快之外，还在于恰好处于国家鼓励的高端制造领域。不可否认，制造业优势企业的崛起能够明显增加我国国力，具有强大竞争力的企业也更可能为股东带来丰厚回报。但理想与现实之间仍存在较大鸿沟。同质性强、众多资本趋之若鹜的行业，企业的生存环境会很快发生恶化。增速快的行业中，并不见得更容易找到好的企业。我们一方面要防范低估值陷阱（即短期估值偏低但长期业绩负增长），也要留意在主流资金普遍防范低估值陷阱、放大悲观预期的背景下，低估值板块带来的投资机会；既要关注产业趋势变

革的趋势，也要清醒地看到潜在的高估与过剩的风险。

部分业绩增速较快、经营状况稳定且估值仍在合理水平的弱周期中小市值企业，仍有较好的性价比。但需要注意的是，在壳价值已经消失、中小市值标的大量上市的今天，进行估值的纵向比较并不能提供重要线索。在过去半年多时间里，中小市值标的整体性跑赢，但不宜简单外推这个趋势。

对于债券部分，利率债与高等级票息策略仍是未来一段时间的合理选择，我们维持中短久期、以高评级信用债和利率债作为持仓品种。如果未来收益率继续下行，我们将着手适度降低组合久期水平。

对于股票，我们仍将保留一部分价值成长类标的，包括可选与必选消费、医药（非创新药相关）以及部分已经得到时间检验的传统行业龙头。从估值水平上看，这部分资产整体处于合理水平，我们将积极增配回落至价值区间且基本面仍在持续改善的大市值龙头品种。除此之外，我们从自上而下和自下而上两个维度出发，不断发掘部分细分行业中，市值较小、估值较低但基本面具有改善趋势和改善空间的公司。一旦这些公司出现估值提升，则股价上行空间也会很大。对于地产、采掘、非银金融等行业集中度仍有待于进一步提升的传统行业，考虑目前较为合理的估值水平，我们仍保留一定比例持仓，并密切跟踪这些行业自身的基本面变化，例如行业内的企业数量变化、行业份额变化等，对出现格局优化、治理水平改善的行业，我们将会增配其中的优质品种。对于化工、机械、有色等周期属性明显但供给侧有明显变化的行业，我们将选取其中的优势标的，分散配置。

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；

- Ⓒ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资管理部门问讯；
- Ⓒ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期共进行了 1 次分红，2021 年 1 月 4 日分红，每 10 份派发 1.004 元，分配红利总金额 66,910,072.05 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元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对新华红利回报混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

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

本托管人依法对新华基金管理股份有限公司编制和披露的新华红利回报混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产
托管部

2021 年 8 月 20

日

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华红利回报混合型证券投资基金

报告截止日：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
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	18,879,546.80	11,175,589.32
结算备付金		30,970.19	41,587.44
存出保证金		33,545.18	46,485.16
交易性金融资产	6.4.7.2	827,333,936.16	921,792,696.61
其中：股票投资		142,957,271.04	164,817,582.86
基金投资		-	-
债券投资		684,376,665.12	756,975,113.75
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-	-
应收证券清算款		80,040.01	2,631,082.63
应收利息	6.4.7.4	6,384,449.63	8,053,245.15
应收股利		-	-
应收申购款		1,941,958.59	2,257,113.97
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		854,684,446.56	945,997,800.28
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
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		28,889,865.55	111,671,824.16
应付证券清算款		2,663,142.86	-
应付赎回款		2,199,163.98	3,021,320.27
应付管理人报酬		726,725.50	1,078,662.04
应付托管费		121,120.88	179,777.03
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.5	142,275.41	123,278.35
应交税费		20,141.34	26,319.59
应付利息		2,429.82	4,939.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	109,881.05	207,456.01
负债合计		34,874,746.39	116,313,576.62
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.7	717,393,948.78	682,492,828.27
未分配利润	6.4.7.8	102,415,751.39	147,191,395.39
所有者权益合计		819,809,700.17	829,684,223.66
负债和所有者权益总计		854,684,446.56	945,997,800.28

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1428 元，基金份额 717,393,948.78 份。

6.2 利润表

会计主体：新华红利回报混合型证券投资基金

本报告期：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
一、收入		18,963,528.42	5,874,322.87
1.利息收入		6,432,560.77	341,902.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,580.30	9,201.11
债券利息收入		6,400,870.42	286,437.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		110.05	46,263.65
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,745,614.13	15,639,105.52
其中：股票投资收益	6.4.7.10	22,344,294.64	15,232,166.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,305,506.94	385,315.21
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	1,095,812.55	21,624.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-15,059,979.02	-10,264,307.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	845,332.54	157,623.02

减：二、费用		6,431,308.39	920,103.69
1. 管理人报酬		4,223,116.78	505,229.33
2. 托管费		703,852.73	84,204.86
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.15	319,082.81	209,194.20
5. 利息支出		1,029,972.84	315.39
其中：卖出回购金融资产支出		1,029,972.84	315.39
6.税金及附加		11,015.03	658.21
7. 其他费用	6.4.7.16	144,268.20	120,501.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,532,220.03	4,954,219.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,532,220.03	4,954,219.18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华红利回报混合型证券投资基金

本报告期：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）	682,492,828.27	147,191,395.39	829,684,223.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,532,220.03	12,532,220.03
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）	34,901,120.51	9,602,208.02	44,503,328.53
其中：1.基金申购款	558,221,948.12	77,122,238.40	635,344,186.52
2.基金赎回款	-523,320,827.61	-67,520,030.38	-590,840,857.99
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）	-	-66,910,072.05	-66,910,072.05
五、期末所有者权益（基金净值）	717,393,948.78	102,415,751.39	819,809,700.17
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）	91,975,085.39	19,342,835.86	111,317,921.25

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,954,219.18	4,954,219.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-43,839,010.57	-2,313,206.62	-46,152,217.19
其中：1.基金申购款	44,447,769.37	7,253,686.64	51,701,456.01
2.基金赎回款	-88,286,779.94	-9,566,893.26	-97,853,673.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-16,626,791.70	-16,626,791.70
五、期末所有者权益（基金净值）	48,136,074.82	5,357,056.72	53,493,131.54

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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金及到期日在一年以内的政府债券，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-80%，权证投资占基金资产净值

的比例为 0-3%，每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 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，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则——基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华红利回报混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计估计与上年度一致，会计政策与上年度一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税征收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》的规定：2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 号）、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140 号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2 号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56 号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90 号）的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，证券投资基金在运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照现行规定缴纳增值税及附加税费。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定：对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时，对个人持股 1 年以内（含 1 年）的，上市

公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	18,879,546.80
定期存款	-
其他存款	-
合计	18,879,546.80

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	139,361,085.60	142,957,271.04	3,596,185.44
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	23,836,865.12	148,337.49
	银行间市场	660,539,800.00	1,887,278.02
	合计	684,376,665.12	2,035,615.51
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	821,702,135.21	827,333,936.16	5,631,800.95

6.4.7.3 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	1,218.08
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	26.19
应收债券利息	6,383,205.36
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	6,384,449.63

注：结算备付金利息包含存出保证金利息。

6.4.7.4 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	128,622.79
银行间市场应付交易费用	13,652.62
合计	142,275.41

6.4.7.5 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	1,702.10
应付证券出借违约金	-
预提费用	108,178.95
合计	109,881.05

6.4.7.6 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	682,492,828.27	682,492,828.27
本期申购	558,221,948.12	558,221,948.12
本期赎回（以“-”号填列）	-523,320,827.61	-523,320,827.61
本期末	717,393,948.78	717,393,948.78

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.7 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	127,844,749.87	19,346,645.52	147,191,395.39
本期利润	27,592,199.05	-15,059,979.02	12,532,220.03
本期基金份额交易产生的变动数	15,356,515.12	-5,754,307.10	9,602,208.02
其中：基金申购款	72,551,659.74	4,570,578.66	77,122,238.40
基金赎回款	-57,195,144.62	-10,324,885.76	-67,520,030.38
本期已分配利润	-66,910,072.05	-	-66,910,072.05
本期末	103,883,391.99	-1,467,640.60	102,415,751.39

6.4.7.8 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	30,270.99
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	1,309.31
其他	-
合计	31,580.30

注：结算备付金利息包含存出保证金利息。

6.4.7.9 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	114,885,146.45
减：卖出股票成本总额	92,540,851.81
买卖股票差价收入	22,344,294.64

6.4.7.10 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	488,500,382.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	480,140,859.43
减：应收利息总额	5,054,016.22
买卖债券差价收入	3,305,506.94

6.4.7.11 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	1,095,812.55
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	1,095,812.55

6.4.7.12 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	-15,059,979.02
——股票投资	-14,734,483.11
——债券投资	-325,495.91
——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	-15,059,979.02

6.4.7.13 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	844,175.72
转换费收入	1,156.82
合计	845,332.54

6.4.7.14 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	310,507.81
银行间市场交易费用	8,575.00
合计	319,082.81

6.4.7.15 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	27,000.00
汇划手续费	17,489.25
指数使用费	-
其他	600.00
合计	144,268.20

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

截至本报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	6,438,269.74	3.32%	12,379,196.90	11.06%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	2,119,659.06	10.07%	-	-

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 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	5,600,000.00	8.85%	21,100,000.00	4.82%

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	4,708.39	3.00%	6,193.26	4.82%
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	9,053.01	9.43%	9,053.01	10.39%

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	4,223,116.78
其中：支付销售机构的客户维护费	2,057,635.64	127,610.79

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

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	703,852.73

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

报告期内无转融通出借业务。

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

报告期内无转融通出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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
中国工商银行股份有限公司	18,879,546.80	30,270.99	436,721.87	6,274.43

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额	现金形式发放总额	再投资形式发放总	利润分配合计	备注

		场 内	场 外	分红数		额		
1	2021-01-04	2021-01-04	2021-01-04	1.004	48,985,831.87	17,924,240.18	66,910,072.05	-
合计				1.004	48,985,831.87	17,924,240.18	66,910,072.05	-

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
688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	新股锁定期内	18.98	27.98	5,354.00	101,618.92	149,804.92	-
688345	博力威	2021-06-03	2021-12-13	新股锁定期内	25.91	55.53	2,332.00	60,422.12	129,495.96	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定期内	47.33	251.96	454.00	21,487.82	114,389.84	-
688636	智明达	2021-03-30	2021-10-08	新股锁定期内	34.50	80.72	918.00	31,671.00	74,100.96	-
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	新股锁定期内	16.49	37.79	1,499.00	24,718.51	56,647.21	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	网下中签	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
688685	迈信林	2021-04-30	2021-11-15	新股锁定期内	9.02	19.50	2,612.00	23,560.24	50,934.00	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定期内	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股锁定	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-

				期内						
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	网下中签	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定期内	24.69	31.71	492.00	12,147.48	15,601.32	-
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	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定期内	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定期内	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股锁定期内	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-07	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	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定期内	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定期内	12.85	25.80	371.00	4,767.35	9,571.80	-
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	-

300931	通用 电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股 锁定期内	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水 海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股 锁定期内	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
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	-
605162	新中 港	2021-06-29	2021-07-07	网下 中签	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
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	-
300926	博俊 科技	2020-12-29	2021-07-07	新股 锁定期内	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马 遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股 锁定期内	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	-
300991	创益 通	2021-05-12	2021-11-22	新股 锁定期内	13.06	26.51	254.00	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天 化学	2020-12-29	2021-07-07	新股 锁定期内	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
301011	华立 科技	2021-06-09	2021-12-17	新股 锁定期内	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
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	-
300929	华骐 环保	2021-01-12	2021-07-20	新股 锁定期内	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业 科技	2021-03-22	2021-09-29	新股 锁定期内	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	-
301007	德迈 仕	2021-06-04	2021-12-16	新股 锁定期内	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波 方正	2021-05-25	2021-12-02	新股 锁定期内	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-

301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股锁定期内	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定期内	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定期内	24.60	163.00	610.00	15,006.00	99,430.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责

任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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	20,122,000.00	59,926,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	80,029,000.00	0.00
合计	100,151,000.00	59,926,000.00

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	208,265,165.12	165,845,813.75
AAA 以下	995,500.00	997,500.00
未评级	374,965,000.00	530,205,800.00
合计	584,225,665.12	697,049,113.75

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 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	18,879,546.80	-	-	-	18,879,546.80
结算备付金	30,970.19	-	-	-	30,970.19
存出保证金	33,545.18	-	-	-	33,545.18
交易性金融资产	242,374,500.00	321,993,271.00	120,008,894.12	142,957,271.04	827,333,936.16
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	-	-	-	80,040.01	80,040.01
应收利息	-	-	-	6,384,449.63	6,384,449.63
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	1,941,958.59	1,941,958.59
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	261,318,562.17	321,993,271.00	120,008,894.12	151,363,719.27	854,684,446.56
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	28,889,865.55	-	-	-	28,889,865.55
应付证券清算款	-	-	-	2,663,142.86	2,663,142.86
应付赎回款	-	-	-	2,199,163.98	2,199,163.98
应付管理人报酬	-	-	-	726,725.50	726,725.50
应付托管费	-	-	-	121,120.88	121,120.88

应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	142,275.41	142,275.41
应交税费	-	-	-	20,141.34	20,141.34
应付利息	-	-	-	2,429.82	2,429.82
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	109,881.05	109,881.05
负债总计	28,889,865.55	0.00	0.00	5,984,880.84	34,874,746.39
利率敏感度缺口	232,428,696.62	321,993,271.00	120,008,894.12	145,378,838.43	819,809,700.17
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	11,175,589.32	-	-	-	11,175,589.32
结算备付金	41,587.44	-	-	-	41,587.44
存出保证金	46,485.16	-	-	-	46,485.16
交易性金融资产	610,733,300.00	11,267,820.00	134,973,993.75	164,817,582.86	921,792,696.61
衍生金融资产	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	2,631,082.63	2,631,082.63
应收利息	-	-	-	8,053,245.15	8,053,245.15
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	2,257,113.97	2,257,113.97
其他资产	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	0.00	0.00
-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	0.00
资产总计	621,996,961.92	11,267,820.00	134,973,993.75	177,759,024.61	945,997,800.28
负债					
短期借款	-	-	-	-	0.00
交易性金融负债	-	-	-	-	0.00

衍生金融负债	-	-	-	-	0.00
卖出回购金融资产款	111,671,824.16	-	-	-	111,671,824.16
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	3,021,320.27	3,021,320.27
应付管理人报酬	-	-	-	1,078,662.04	1,078,662.04
应付托管费	-	-	-	179,777.03	179,777.03
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	123,278.35	123,278.35
应付税费	-	-	-	26,319.59	26,319.59
应付利息	-	-	-	4,939.17	4,939.17
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	207,456.01	207,456.01
-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	0.00
负债总计	111,671,824.16	0.00	0.00	4,641,752.46	116,313,576.62
利率敏感度缺口	510,325,137.76	11,267,820.00	134,973,993.75	173,117,272.15	829,684,223.66

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 25.00 bp		-3,035,003.61
市场利率下降 25.00 bp		3,089,133.01	2,981,213.86

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 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	142,957,271.04	17.44	164,817,582.86	19.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	684,376,665.12	83.48	756,975,113.75	91.24
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	827,333,936.16	100.92	921,792,696.61	111.10

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	1,138,432.49	1,536,512.48
	沪深 300 指数下降 1%	-1,138,432.49	-1,536,512.48

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	142,957,271.04	16.73
	其中：股票	142,957,271.04	16.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	684,376,665.12	80.07
	其中：债券	684,376,665.12	80.07
	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	18,910,516.99	2.21
8	其他各项资产	8,439,993.41	0.99
9	合计	854,684,446.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,469,820.00	0.55
C	制造业	87,890,601.19	10.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,820,060.39	0.34
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	116,654.36	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,134,712.00	0.38
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,403,506.83	0.54
J	金融业	11,655,835.52	1.42
K	房地产业	14,235,049.00	1.74
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,138,175.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	31,153.31	0.00
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	12,050,689.00	1.47
S	综合	-	-
	合计	142,957,271.04	17.44

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	000651	格力电器	119,700	6,236,370.00	0.76
2	600285	羚锐制药	579,800	6,087,900.00	0.74
3	601318	中国平安	83,200	5,348,096.00	0.65
4	000002	万科A	221,100	5,264,391.00	0.64
5	300059	东方财富	160,298	5,256,171.42	0.64
6	600887	伊利股份	131,700	4,850,511.00	0.59
7	601799	星宇股份	20,700	4,672,404.00	0.57
8	300413	芒果超媒	66,000	4,527,600.00	0.55
9	601225	陕西煤业	377,200	4,469,820.00	0.55
10	000999	华润三九	156,801	4,194,426.75	0.51
11	600750	江中药业	306,100	4,055,825.00	0.49
12	300788	中信出版	106,700	3,923,359.00	0.48
13	000333	美的集团	54,700	3,903,939.00	0.48
14	000568	泸州老窖	16,400	3,869,416.00	0.47
15	300251	光线传媒	333,000	3,599,730.00	0.44
16	600660	福耀玻璃	62,500	3,490,625.00	0.43
17	600383	金地集团	338,300	3,464,192.00	0.42
18	603589	口子窖	47,000	3,181,430.00	0.39
19	601006	大秦铁路	476,400	3,134,712.00	0.38
20	600048	保利地产	254,900	3,068,996.00	0.37
21	600309	万华化学	28,100	3,057,842.00	0.37

22	600519	贵州茅台	1,400	2,879,380.00	0.35
23	300910	瑞丰新材	27,396	2,864,251.80	0.35
24	002643	万润股份	161,000	2,862,580.00	0.35
25	600900	长江电力	136,000	2,807,040.00	0.34
26	000860	顺鑫农业	60,769	2,563,236.42	0.31
27	001979	招商蛇口	222,600	2,437,470.00	0.30
28	600690	海尔智家	92,500	2,396,675.00	0.29
29	000858	五粮液	7,400	2,204,386.00	0.27
30	300284	苏交科	365,500	2,138,175.00	0.26
31	600585	海螺水泥	52,000	2,134,600.00	0.26
32	002461	珠江啤酒	187,000	2,045,780.00	0.25
33	002001	新和成	69,120	1,982,361.60	0.24
34	300132	青松股份	93,400	1,970,740.00	0.24
35	600570	恒生电子	20,500	1,911,625.00	0.23
36	600031	三一重工	65,300	1,898,271.00	0.23
37	000059	华锦股份	225,000	1,836,000.00	0.22
38	603855	华荣股份	103,000	1,761,300.00	0.21
39	002555	三七互娱	72,900	1,751,058.00	0.21
40	688558	国盛智科	47,385	1,729,552.50	0.21
41	300421	力星股份	100,000	1,649,000.00	0.20
42	600872	中炬高新	38,500	1,617,770.00	0.20
43	002242	九阳股份	40,000	1,299,600.00	0.16
44	603369	今世缘	20,000	1,083,200.00	0.13
45	000338	潍柴动力	60,000	1,072,200.00	0.13
46	601601	中国太保	35,100	1,016,847.00	0.12
47	002557	洽洽食品	20,000	862,000.00	0.11
48	600588	用友网络	21,600	718,416.00	0.09
49	002475	立讯精密	12,700	584,200.00	0.07
50	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.02
51	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.02
52	300957	贝泰妮	454	114,389.84	0.01
53	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
54	601933	永辉超市	20,000	94,600.00	0.01
55	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
56	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.01
57	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
58	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
59	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
60	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
61	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
62	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
63	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
64	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
65	300940	南极光	307	13,317.66	0.00

66	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
67	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
68	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
69	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
70	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
71	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
72	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
73	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
74	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
75	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
76	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
77	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
78	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
79	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
80	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
81	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
82	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
83	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
84	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
85	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
86	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
87	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
88	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
89	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
90	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
91	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
92	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
93	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
94	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
95	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
96	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	600285	羚锐制药	5,436,027.00	0.66
2	300788	中信出版	4,466,432.80	0.54
3	603589	口子窖	4,234,318.19	0.51
4	600383	金地集团	3,824,195.00	0.46

5	601689	拓普集团	3,615,257.00	0.44
6	300887	谱尼测试	2,973,887.84	0.36
7	600660	福耀玻璃	2,936,631.00	0.35
8	600702	舍得酒业	2,831,697.92	0.34
9	600900	长江电力	2,774,680.00	0.33
10	002643	万润股份	2,728,127.00	0.33
11	600585	海螺水泥	2,492,962.00	0.30
12	000651	格力电器	2,375,732.79	0.29
13	002461	珠江啤酒	2,253,161.00	0.27
14	300284	苏交科	2,151,356.00	0.26
15	001979	招商蛇口	2,056,900.00	0.25
16	300910	瑞丰新材	2,023,174.04	0.24
17	300132	青松股份	1,992,390.54	0.24
18	002242	九阳股份	1,973,902.00	0.24
19	000002	万 科 A	1,905,402.00	0.23
20	603855	华荣股份	1,860,487.00	0.22

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600276	恒瑞医药	5,290,311.10	0.64
2	600702	舍得酒业	4,530,422.00	0.55
3	603259	药明康德	4,371,805.60	0.53
4	600585	海螺水泥	4,334,676.00	0.52
5	600031	三一重工	4,033,830.84	0.49
6	300059	东方财富	4,009,460.00	0.48
7	002126	银轮股份	3,798,935.22	0.46
8	600690	海尔智家	3,758,833.00	0.45
9	601689	拓普集团	3,658,762.00	0.44
10	300887	谱尼测试	3,329,524.88	0.40
11	002242	九阳股份	3,322,339.00	0.40
12	300347	泰格医药	3,260,619.00	0.39
13	002901	大博医疗	3,104,858.00	0.37
14	601668	中国建筑	3,082,280.00	0.37
15	601006	大秦铁路	2,761,570.00	0.33
16	002821	凯莱英	2,660,475.00	0.32
17	000568	泸州老窖	2,644,896.91	0.32
18	002304	洋河股份	2,376,064.00	0.29
19	601933	永辉超市	2,292,600.00	0.28

20	600741	华域汽车	2,136,720.00	0.26
----	--------	------	--------------	------

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	85,415,023.10
卖出股票的收入（成交）总额	114,885,146.45

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	156,835,800.00	19.13
	其中：政策性金融债	154,946,000.00	18.90
4	企业债券	51,469,500.00	6.28
5	企业短期融资券	320,170,000.00	39.05
6	中期票据	133,060,000.00	16.23
7	可转债（可交换债）	22,841,365.12	2.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	684,376,665.12	83.48

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	200404	20 农发 04	1,200,000	114,936,000.00	14.02
2	101801455	18 中铝集	300,000	30,297,000.00	3.70

		MTN005			
3	1822035	18 工银租赁债 01	300,000	30,288,000.00	3.69
4	042100183	21 电网 CP001	300,000	30,051,000.00	3.67
5	012101389	21 华润 SCP001	300,000	30,045,000.00	3.66

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末尚无国债期货投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1“18工银租赁债01”发行人工银金融租赁有限公司因存在违规开展尽职调查；租赁物权属调查、确权等管理工作存在严重不足的行为，天津银保监局依据相关规定，对其罚款人民币 100 万元。（津银保监罚决字（2020）101 号，2020 年 12 月 29 日）

工银金融租赁有限公司因对监管核准的营业场所不具备使用权，严重违反审慎经营规则，天津银保监局对其罚款人民币 20 万元。（津银保监罚决字（2020）102 号，2020 年 12 月 29 日）

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。

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

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	33,545.18
2	应收证券清算款	80,040.01
3	应收股利	-
4	应收利息	6,384,449.63
5	应收申购款	1,941,958.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,439,993.41

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	9,833,280.00	1.20
2	113021	中信转债	1,509,651.00	0.18
3	110057	现代转债	1,006,290.00	0.12

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,420	132,360.51	10,737,751.00	1.50%	706,656,197.78	98.50%

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	472,892.72	0.07%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年3月27日）基金份额总额	272,798,500.29
本报告期期初基金份额总额	682,492,828.27
本报告期基金总申购份额	558,221,948.12
减：本报告期基金总赎回份额	523,320,827.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	717,393,948.78

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

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。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

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，并已向中国证券投资基金业协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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
湘财证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	49,120,848.64	25.34%	43,585.45	27.73%	-
天风证券	4	40,114,841.06	20.69%	29,335.92	18.67%	-
中信证券	3	28,697,703.65	14.80%	25,990.45	16.54%	-
中信建投证券	2	28,138,072.43	14.51%	20,577.69	13.09%	-
东北证券	2	9,065,862.04	4.68%	6,630.22	4.22%	-
开源证券	2	8,221,889.28	4.24%	6,012.44	3.83%	-
广发证券	3	6,832,964.74	3.52%	5,315.82	3.38%	-
恒泰证券	2	6,438,269.74	3.32%	4,708.39	3.00%	-
国泰君安	1	6,250,751.56	3.22%	5,821.48	3.70%	-
方正证券	1	4,581,816.69	2.36%	3,350.78	2.13%	-
招商证券	1	3,135,203.91	1.62%	2,919.83	1.86%	-
海通证券	1	1,478,378.87	0.76%	1,376.76	0.88%	-
安信证券	1	1,125,362.00	0.58%	1,048.06	0.67%	-
华泰证券	1	677,838.00	0.35%	495.68	0.32%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用34个交易席位，其中报告期内新增3个交易席位，退租1个交易席位。其中新增席位为：开源证券上海席位、开源证券深圳席位、民生证券上海席位；其中

退租席位为：华安证券上海席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

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

二、交易席位的选择流程

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

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

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

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
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

国元证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	1,230,299.08	5.85%	1,000,000.00	1.58%	-	-
中信证券	7,736,478.10	36.76%	31,300,000.00	49.45%	-	-
中信建投证券	363,636.00	1.73%	3,000,000.00	4.74%	-	-
东北证券	7,151,482.60	33.98%	-	-	-	-
开源证券	-	-	4,300,000.00	6.79%	-	-
广发证券	-	-	6,100,000.00	9.64%	-	-
恒泰证券	2,119,659.06	10.07%	5,600,000.00	8.85%	-	-
国泰君安	-	-	9,000,000.00	14.22%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	2,443,546.00	11.61%	3,000,000.00	4.74%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

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新华红利回报混	上海证券报、公司网站、	2021-01-14

	混合型证券投资基金基金暂停（大额）申购（转换转入、定期定额投资）公告	电子信披网站	
6	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
7	新华基金管理股份有限公司关于新华优选分红混合型证券投资基金恢复大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2021-01-19
8	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
9	新华红利回报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
10	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
11	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
12	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
13	新华红利回报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
14	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
15	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
16	新华红利回报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
17	新华红利回报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	2021-05-07
18	新华红利回报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	2021-05-07
19	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
20	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
21	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	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	2021-05-11

	业务的公告		
22	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-05-20
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、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
24	新华基金管理股份有限公司关于新华红利回报混合型证券投资基金参加中国民生银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2021-06-01
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 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华红利回报混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华红利回报混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华红利回报混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华红利回报混合型证券投资基金基金合同
- (五) 新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六) 《新华红利回报混合型证券投资基金招募说明书》(更新)
- (七) 《新华红利回报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