

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中 基金(FOF)

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十日

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 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
1.2 目录.....	3
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.....	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
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合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	11
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.....	12
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.....	12
5 托管人报告	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
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
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.....	18
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	35
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.....	35
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.....	35
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.....	35
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.12 本报告期投资基金情况.....	36

7.13 投资组合报告附注.....	37
8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
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.....	39
9 开放式基金份额变动.....	39
10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	40
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.9 其他重大事件.....	43
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)
基金简称	新华精选成长主题 3 个月持有期混合(FOF)
基金主代码	009146
交易代码	009146
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 26 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	14,687,270.66 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露	姓名	齐岩	秦一楠
	联系电话	010-68779688	010-66060069

负责人	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街28号 凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		400010	100031
法定代表人		翟晨曦	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	154,904.09
本期利润	-2,516,419.65
加权平均基金份额本期利润	-0.1526
本期加权平均净值利润率	-13.72%
本期基金份额净值增长率	-10.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,179,563.03
期末可供分配基金份额利润	0.1484
期末基金资产净值	16,866,833.69
期末基金份额净值	1.1484

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.84%

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 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	8.49%	1.07%	4.22%	0.66%	4.27%	0.41%
过去三个月	6.13%	1.31%	1.89%	1.05%	4.24%	0.26%
过去六个月	-10.01%	1.26%	-6.52%	0.98%	-3.49%	0.28%
过去一年	-13.85%	1.09%	-0.65%	0.80%	-13.20%	0.29%
自基金合同生效起至今	14.84%	1.07%	16.85%	0.76%	-2.01%	0.31%

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

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

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)

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

（2020 年 4 月 26 日至 2022 年 6 月 30 日）



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 2022 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、新华鑫弘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）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王奕蕾	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司基金投资部总监。	2020-04-26	-	10	金融学硕士，历任方正证券股份有限公司研究所研究员，先后担任固定收益分析师和基金分析师，新华基金投资经理。

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。

4.1.3 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精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金

(FOF) 的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》以及其它有关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规, 无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内, 基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定。

基金管理人对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明: 债券同向交易频率偏低; 股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断, 即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大, 结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生, 本报告期内, 未发生有投资组合参与的交易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

今年上半年，股票市场发生了较大波动。年初至春节，全球复苏预期持续增强叠加海外刺激政策不断加码，顺周期板块表现强势；同时资金持续流入核心资产，使得结构分化加剧。然而，随着大宗商品价格的持续上涨，市场通胀预期抬升、美债收益率快速上行，对流动性收紧的恐慌使得股市在春节后迅速回落，此前被投资者拥抱的高估值龙头白马股普遍大幅回调。在市场整体避险情绪提升以及“碳中和”主线的催化下，前期涨幅较小的中小盘价值风格及周期类资产表现较好。进入二季度，前期市场的急速下跌得到一定修正，市场从白酒到医药，再到新能源车相继修复。五一期间耶伦在讲话中提到基建刺激可能引发通胀，被市场过度解读为其在暗示加息，五一过后科技股剧烈回调。而海外疫情持续恶化，致使商品的供需缺口再次拉大，大宗商品普涨，国内钢铁限产力度持续加大等一系列事件冲击，促成周期品快速上涨。市场一方面担心中游制造业的利润受到挤压；另一方面担心涨价向下游传导，带来通胀超预期，而这再度加重了市场对于流动性的担忧，导致市场再次出现调整。5月中旬以来，美国非农数据持续不及预期、国内出台针对上游资源品的稳供保价政策等事件带动流动性收紧预期明显回落，市场在5月下旬迎来一轮较大反弹。当前，市场成长风格演绎比较极致，近期新能源车、半导体等板块的涨幅较大，而消费、金融、医药等表现不佳。

伴随着市场的变化，我们对组合进行了一定的结构调整，3月市场跌幅较大，自3月以来持续减持了一些核心资产较为集中的基金产品，伴随着四月市场企稳反弹，逐渐减持了前期某些用于防御的和消费较为集中的主动管理权益基金。5月下旬反弹的过程中，我们加仓了芯片ETF及军工ETF，整体来说组合的新能源车及芯片的投资占比有所提高，在后续的反弹中表现较好。反思投资中的问题，确实有一些核心标的基金中有一些后周期的板块配置不及预期，后续还需持续对这些行业进行紧密跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年6月30日，本基金份额净值为1.1484元，本报告期份额净值增长率为-10.01%，同期业绩比较基准的增长率为-6.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，权益市场方面，5月以来的快速反弹确实涨幅较大，同时后续二季报盈利很差可能会给市场带来一些负面的影响，但我们认为市场不太可能出现二季度快速下跌的情形，7月开始已经有一定的调整，风险一定程度上得到释放，市场有望震荡向上。因此我们计划维持高权益仓位。

总体上来讲，由于通胀数据低于预期，美联储激进加息的预期有所缓解，因此我们还会保持一定成长风格的暴露，后续将根据经济复苏的数据及节奏、稳增长政策的推进方向及力度、美联储后续的态度进行风格上的调整。

短期，直接受益于稳增长政策持续加码，地产行业风险化解方案逐步推进，风险偏好有所修复，此前我们也强调，要调高 2022 年的通胀预期，因此需要对高通胀方向做适度配置，如煤炭、有色、农林牧渔等价格型资产。受益于疫情缓解，航空、机场、旅游、酒店、餐饮、食品饮料等行业将会迎来阶段性的修复，但是中期来看，我们还是依旧看好成长板块，新能源是今年政策最确定的方向，未来还是会持续维持较高景气，消费电子也处于底部位置，市场关注度逐渐提升，具备较好的配置价值，将会积极把握新能源、半导体、汽车智能化、军工等领域的投资机会，在成长板块中进行一定结构的调整以应对伪成长中报盈利较差可能产生的下跌。还应该深挖在成长风格上具备一定板块轮动以及有一定均衡思维的基金经理进行配置。同时优选投资于新基建领域的基金产品作为中期的持仓。

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，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金自 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日出现连续一百一十七个工作日，出现基金资产净值低于五千万的情形。

我司将通过多方面的措施促进本基金的规模增长，具体经营计划如下：

（一）与主要销售机构合作制定销售计划，以重点地区为主，将公司的资源向重点地区倾斜。

（二）进一步加强与潜在销售机构的合作，拓宽渠道和客户资源。

（三）采用新客户开发与老客户深入挖掘并重的客户开发方式。

（四）加强投资者教育，引导投资者充分认识产品的风险收益特点。综上所述，本基金为我司产品线主要组成部分。受市场环境影响，本基金规模出现缩减。我司将在做好基金日常投资运营的同时，加大持续营销工作投入，同时探索其他方式和手段，尽力提升基金规模。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)

报告截止日：2022年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,629,557.59	2,285,171.33
结算备付金		-	3,515.97
存出保证金		179.91	3,761.64
交易性金融资产	6.4.7.2	15,281,067.30	22,541,332.64
其中：股票投资		-	-
基金投资		15,281,067.30	22,541,332.64
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		-	39,920.21
应收股利		-	-
应收申购款		167.83	824.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	473.98
资产总计		16,910,972.63	24,875,000.27
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,937.53	4,539.18
应付管理人报酬		12,049.81	19,258.98
应付托管费		2,352.68	3,841.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	24,798.92	160,005.07
负债合计		44,138.94	187,645.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	14,687,270.66	19,346,212.26
其他综合收益	6.4.7.1 1	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,179,563.03	5,341,142.92
净资产合计		16,866,833.69	24,687,355.18
负债和净资产总计		16,910,972.63	24,875,000.27

注：报告截止2022年6月30日，基金份额净值1.1484元，基金份额总额14,687,270.66份。

6.2 利润表

会计主体：新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至 2021年6月30日
一、营业总收入		-2,391,004.60	2,239,522.90
1.利息收入		7,022.79	21,674.75
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,022.79	21,674.75
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		273,152.62	3,280,286.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益	6.4.7.15	-86,890.86	2,224,467.29
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	360,043.48	1,055,819.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-2,671,323.74	-1,143,442.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	143.73	81,004.25
减：二、营业总支出		125,415.05	558,549.32
1. 管理人报酬		83,058.82	301,824.33
2. 托管费		16,325.77	62,557.05
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		-	765.93
8. 其他费用	6.4.7.23	26,030.46	193,402.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,516,419.65	1,680,973.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,516,419.65	1,680,973.58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,516,419.65	1,680,973.58

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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）	19,346,212.26	-	5,341,142.92	24,687,355.18
二、本期期初净资产（基金净值）	19,346,212.26	-	5,341,142.92	24,687,355.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,658,941.60	-	-3,161,579.89	-7,820,521.49
（一）、综合收益总额	-	-	-2,516,419.65	-2,516,419.65
（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）	-4,658,941.60	-	-645,160.24	-5,304,101.84

其中：1.基金申购款	215,256.59	-	24,564.21	239,820.80
2.基金赎回款	-4,874,198.19	-	-669,724.45	-5,543,922.64
(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)	14,687,270.66	-	2,179,563.03	16,866,833.69
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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)	63,320,677.50	-	16,622,358.10	79,943,035.60
二、本期期初净资产(基金净值)	63,320,677.50	-	16,622,358.10	79,943,035.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-24,077,624.20	-	-3,551,786.22	-27,629,410.42
(一)、综合收益总额	-	-	1,680,973.58	1,680,973.58
(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)	-24,077,624.20	-	-5,232,759.80	-29,310,384.00
其中：1.基金申购款	19,297,547.85	-	6,176,354.46	25,473,902.31
2.基金赎回款	-43,375,172.05	-	-11,409,114.26	-54,784,286.31
(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)	39,243,053.30	-	13,070,571.88	52,313,625.18

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

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]279 号文件“关于核准新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复”，由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于 2020 年 4 月 1 日至 4 月 23 日向社会公开募集，首次募集资金总额 222,428,427.57 元，其中募集净认购资金金额 222,344,891.81 元，募集资金产生利息 83,535.76 元，并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2020]第 36010005 号验资报告予以验证。2020 年 4 月 26 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不限定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》及《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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，包括经中国证监会核准或注册的证券投资基金、国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具（含同业存单）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资于 QDII 基金、香港互认基金，也不投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金。本基金不直接在二级市场买入股票，也不参与一级市场新股申购和新股增发。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会核准或注册的基金份额占基金资产的比例不低于 80%，股票型基金的投资占基金资产的比例为 10%-50%，投资于“精选成长组合”成份基金的比例不低于非现金基金资产的 80%。现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

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 2022 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，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月

15 日及其后颁布和修订的 42 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”），中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》，《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动等有关信息。

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

除 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则外，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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。新金融工具准则的执行对本基金的财务状况和经营成果未产生重大影响。

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

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 2022年6月30日
活期存款	1,629,557.59
等于：本金	1,629,317.43
加：应计利息	240.16
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	1,629,557.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
基金	15,851,193.95	-	15,281,067.30	-570,126.65
其他	-	-	-	-
合计	15,851,193.95	-	15,281,067.30	-570,126.65

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

本基金报告期末未持有金融衍生资产和负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金报告期末无买入返售金融资产期末余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金报告期末无买断式逆回购。

6.4.7.5 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 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.73
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
审计费	24,795.19
合计	24,798.92

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,346,212.26	19,346,212.26
本期申购	215,256.59	215,256.59
本期赎回（以“-”号填列）	-4,874,198.19	-4,874,198.19
本期末	14,687,270.66	14,687,270.66

注：申购含红利再投、转换入份额、赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 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	11,389,639.23	-6,048,496.31	5,341,142.92
本期利润	154,904.09	-2,671,323.74	-2,516,419.65
本期基金份额交易产生的变动数	-2,707,627.83	2,062,467.59	-645,160.24
其中：基金申购款	125,562.20	-100,997.99	24,564.21
基金赎回款	-2,833,190.03	2,163,465.58	-669,724.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,836,915.49	-6,657,352.46	2,179,563.03

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	7,008.86
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	13.93
其他	-
合计	7,022.79

注：结算备付金利息收入中包含结算保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

本报告期本基金未投资股票。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	5,633,805.38
减：卖出/赎回基金成本总额	5,707,522.40
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	13,173.84
基金投资收益	-86,890.86

6.4.7.16 债券投资收益

本报告期，本基金无债券投资收益。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益**6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券投资。

6.4.7.18 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.19 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	360,043.48
合计	360,043.48

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-2,671,323.74
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-2,671,323.74
——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	-2,671,323.74

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	143.73
合计	143.73

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,235.27
合计	26,030.46

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

截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的 比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的 比例
恒泰证券股份有限公司	-	-	2,499,771.70	12.41%

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元产生佣金。

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	83,058.82	301,824.33
其中：支付销售机构的客户维护费	37,567.28	127,185.64

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,325.77	62,557.05

注：1、本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金托管人托管的基金部分的余额（若为负数，则取 0）的 0.20% 的年费率计提。逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金托管人托管的基金部分的余额（若为负数，则取 0）×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未发生关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生银行间市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本报告期本基金无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。

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

本报告期本基金无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。

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	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	1,629,557.59	7,008.86	11,882,113.66	21,468.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

项目	本期费用	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	310.71	4,606.02
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	12,684.19	39,845.09
当期持有基金产生的应支付托	2,470.82	5,754.51

管理费（元）		
--------	--	--

6.4.11 利润分配情况

本基金于 2020 年 4 月 26 日成立，至 2022 年 6 月 30 日止无收益分配事项。

6.4.12 期末（2022 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

本报告期间本基金无流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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

本基金本报告期末未有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未有交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未参与转融通业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	1,629,557.59	-	-	-	1,629,557.59
结算备付金	0.00	-	-	-	0.00
存出保证金	179.91	-	-	-	179.91
交易性金融资产	-	-	-	15,281,067.30	15,281,067.30
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	-	-	-	0.00	0.00
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	167.83	167.83
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	1,629,737.50	0.00	0.00	15,281,235.13	16,910,972.63
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	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	4,937.53	4,937.53
应付管理人报酬	-	-	-	12,049.81	12,049.81
应付托管费	-	-	-	2,352.68	2,352.68
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	-	-	-	24,798.92	24,798.92
负债总计	0.00	0.00	0.00	44,138.94	44,138.94
利率敏感度缺口	1,629,737.50	0.00	0.00	15,237,096.19	16,866,833.69
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2021年12月31日					
资产					
银行存款	-	-	-	2,285,171.33	2,285,171.33
结算备付金	-	-	-	3,515.97	3,515.97
存出保证金	-	-	-	3,761.64	3,761.64
交易性金融资产	-	-	-	22,541,332.64	22,541,332.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	39,920.21	39,920.21
应收利息	-	-	-	473.98	473.98
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	824.50	824.50
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	0.00	0.00	0.00	24,875,000.27	24,875,000.27
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,539.18	4,539.18
应付管理人报酬	-	-	-	19,258.98	19,258.98
应付托管费	-	-	-	3,841.86	3,841.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	160,005.07	160,005.07
负债总计	0.00	0.00	0.00	187,645.09	187,645.09
利率敏感度缺口	0.00	0.00	0.00	24,687,355.18	24,687,355.18

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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，所面临的重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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	15,281,067.30	90.60	22,541,332.64	91.31
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	15,281,067.30	90.60	22,541,332.64	91.31

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 1%或者下降 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	-	155,701.26

	沪深 300 指数下降 1%	-	-155,701.26
--	----------------	---	-------------

注：本报告期末，本基金未持有交易性股票投资，因此市场指数的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2022 年 6 月 30 日
第一层次	15,281,067.30
第二层次	-
第三层次	-
合计	15,281,067.30

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 2022 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

根据《企业会计准则第 22 号-金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号-金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号-套期会计》(财会〔2017〕9 号)、

《企业会计准则第37号-金融工具列报》(财会〔2017〕14号)(统称“新金融工具准则”)和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22号)等相关规定,自2022年1月1日起,本基金开始执行新金融工具准则,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	15,281,067.30	90.36
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	1,629,557.59	9.64
8	其他各项资产	347.74	0.00
9	合计	16,910,972.63	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

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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

本报告期末本基金未持有股票。

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

本报告期内本基金未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以

套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	519091	新华泛资源优势混合	契约型开放式	245,484.31	1,639,810.64	9.72%	是
2	001878	嘉实沪港深精选股票	契约型开放式	550,468.95	1,098,185.56	6.51%	否
3	121006	国投瑞银稳健增长混合	契约型开放式	373,241.59	1,076,055.50	6.38%	否
4	217010	招商大盘蓝筹混合	契约型开放式	358,604.25	1,045,689.99	6.20%	否
5	040035	华安逆向策略混合 A	契约型开放式	133,441.67	977,727.12	5.80%	否
6	570001	诺德价值优势混合	契约型开放式	302,428.83	974,728.12	5.78%	否
7	270021	广发聚瑞混合 A	契约型开放式	221,535.18	967,289.06	5.73%	否
8	001410	信达澳银新能源产业股票	契约型开放式	197,717.13	939,749.52	5.57%	否

9	009275	融通医疗 保健行业 混合 C	契约型开 放式	387,435.3 4	897,687.6 8	5.32%	否
10	020010	国泰金牛 创新混合	契约型开 放式	748,603.7 1	833,944.5 3	4.94%	否
11	450004	国富深化 价值混合	契约型开 放式	397,971.6 7	822,607.4 4	4.88%	否
12	540003	汇丰晋信 动态策略 混合 A	契约型开 放式	164,781.3 2	804,412.9 7	4.77%	否
13	004236	中欧新动 力混合 (LOF)C	契约型开 放式	235,083.8 9	794,089.8 7	4.71%	否
14	512760	国泰 CES 半导体芯 片 ETF	契约型开 放式	515,600.0 0	601,705.2 0	3.57%	否
15	202023	南方优选 成长混合 A	契约型开 放式	134,000.0 0	560,656.0 0	3.32%	否
16	001714	工银文体 产业股票 A	契约型开 放式	123,458.2 8	398,646.7 9	2.36%	否
17	512660	国泰中证 军工 ETF	契约型开 放式	282,000.0 0	329,940.0 0	1.96%	否
18	512880	国泰中证 全指证券 公司 ETF	契约型开 放式	223,300.0 0	217,940.8 0	1.29%	否
19	512800	华宝中证 银行 ETF	契约型开 放式	172,098.0 0	196,363.8 2	1.16%	否
20	530006	建信核心 精选混合	契约型开 放式	35,175.03	103,836.6 9	0.62%	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金持有的前十名证券的发行主体本期末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。

7.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	179.91

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	167.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	347.74

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未进行股票投资。

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
776	18,926.90	0.00	0.00%	14,687,270.66	100.00%

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	1,000.17	0.01%
------------------	----------	-------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 26 日）基金份额总额	222,428,427.57
本报告期期初基金份额总额	19,346,212.26
本报告期基金总申购份额	215,256.59
减：本报告期基金总赎回份额	4,874,198.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	14,687,270.66

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

2022 年 5 月 16 日，新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会以通讯方式召开，参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，未达到《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》约定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效条件。

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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金持有的基金未发生重大影响事件。

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

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

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	
中金公司	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	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43个交易席位，其中报告期内新增0个交易席位，退租0个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

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

二、交易席位的选择流程

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

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员分别打分，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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中金公司	-	-	-	-	-	-	125,443.20	30.18%
华创证券	-	-	-	-	-	-	163,030.40	39.22%
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	49,907.20	12.01%
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
大同 证券	-	-	-	-	-	-	77,336.50	18.60%	
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-04
2	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海万得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	2022-01-11
3	新华基金管理股份有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-01-13
4	新华基金管理股份有限公司关于设立上海分	中国证券报、公司网站、	2022-01-13

	公司的公告	电子信披网站	
5	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 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	2022-01-21
6	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)2021 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-01-21
7	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富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	2022-02-15
8	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份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	2022-02-25
9	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京肯特瑞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	上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-01
10	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金(北京)投资管理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	2022-03-07
11	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书(更新)	公司网站、电子信披网站	2022-03-22
12	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金产品资料概要	公司网站、电子信披网站	2022-03-22
13	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 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	2022-03-30
14	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)2021 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2022-03-30
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整在安信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	2022-04-09
16	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告-清洁版	证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-16
17	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告-清洁版	证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-18
18	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告-清洁版	证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-19
19	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 1	中国证券报、上海证券	2022-04-21

	季度报告提示性公告	报、证券时报、证券日报、 公司网站、电子信披网站	
20	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)2022 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-04-21
21	新华基金管理股份有限公司关于新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金份额持有人大会会议情况的公告	证券日报、公司网站、电 子信披网站	2022-05-17
22	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰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	2022-06-10

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
个人	1	20220101 - 20220630	8,755,8 09.40	0.00	3,000,0 00.00	5,755,809.40	39.19%
产品特有风险							
<p>(1) 本基金为基金中基金，T日的基金份额净值在T+2日内公告，估值时间及披露时间与其他类别基金不同；</p> <p>(2) 本基金所投资的基金可能发生重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及其他需要召开基金份额持有人大会的事项等，改变原投资组合的风格和策略，进而会对本基金的投资运作带来影响。</p> <p>(3) 本基金对每份基金份额设置3个月的最短持有期限，即自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日3个月后的月度对日的期间内，投资者不能提出赎回申请；该日3个月后的月度对日之后，投资者可以提出赎回申请。若该月实际不存在对应日期的，则顺延至下一日。最短持有期到期前，基金份额持有人不能提出赎回申请，因此面临流动性风险。</p> <p>(1) 本基金为基金中基金，T日的基金份额净值在T+2日内公告，估值时间及披露时间与其他类别基金不同；</p> <p>(2) 本基金所投资的基金可能发生重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及其他需要召开基金份额持有人大会的事项等，改变原投资组合的风格和策略，进而会对本基金的投资运作带来影响。</p> <p>(3) 本基金对每份基金份额设置3个月的最短持有期限，即自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日3个月后的月度对日的期间内，投资者不能提出赎回申请；该日3个月后的月度对日之后，投资者可以提出赎回申请。若该月实际不存在对应日期的，则顺延至下一日。最短持有期到期前，基金份额持有人不能提出赎回申请，因此面临流动性风险。</p> <p>(4) 本基金投资其他证券投资基金出现净值计算错误、净值披露延迟或间断等情形时，从而给本基金带来估值风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无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精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件
- (二) 关于申请募集新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）之法律意见书
- (三) 新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议
- (四) 新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同
- (五) 新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六) 《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》（更新）
- (七) 《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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

二〇二二年八月三十日