

新华红利回报混合型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：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。

基金托管人中国工商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 |
| 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..... | 16 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 16 |
| 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..... | 17 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 18 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 19 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 20 |
| 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..... | 20 |
| 5 托管人报告 | 20 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 20 |
| 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..... | 20 |
| 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..... | 20 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 20 |
| 6.1 资产负债表..... | 20 |
| 6.2 利润表..... | 22 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 23 |
| 6.4 报表附注..... | 24 |
| 7 投资组合报告 | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 45 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 45 |
| 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..... | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 47 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 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..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 50 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 50 |
| 7.12 本报告期投资基金情况..... | 50 |
| 7.13 投资组合报告附注..... | 51 |
| 8 基金份额持有人信息 | 52 |

| | |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 52 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 52 |
| 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 | 52 |
| 9 开放式基金份额变动 | 53 |
| 10 重大事件揭示 | 53 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 53 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 53 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 53 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 53 |
| 10.9 其他重大事件 | 56 |
| 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 58 |
| 12 备查文件目录 | 58 |
| 12.1 备查文件目录 | 58 |
| 12.2 存放地点 | 59 |
| 12.3 查阅方式 | 59 |

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 | 310,745,786.57 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（2022年1月1日至2022年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | -12,475,260.56 |
| 本期利润 | -12,652,332.61 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0344 |
| 本期加权平均净值利润率 | -2.97% |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.58% |
| 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 | 47,264,773.21 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1521 |
| 期末基金资产净值 | 359,182,806.75 |
| 期末基金份额净值 | 1.1559 |
| 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 | 78.85% |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.93% | 0.14% | 4.59% | 0.53% | -3.66% | -0.39% |
| 过去三个月 | 0.71% | 0.18% | 3.22% | 0.71% | -2.51% | -0.53% |
| 过去六个月 | -2.58% | 0.22% | -4.56% | 0.73% | 1.98% | -0.51% |
| 过去一年 | 1.15% | 0.21% | -6.09% | 0.62% | 7.24% | -0.41% |
| 过去三年 | 50.68% | 0.64% | 11.76% | 0.63% | 38.92% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 78.85% | 0.60% | 19.96% | 0.61% | 58.89% | -0.01% |

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%；

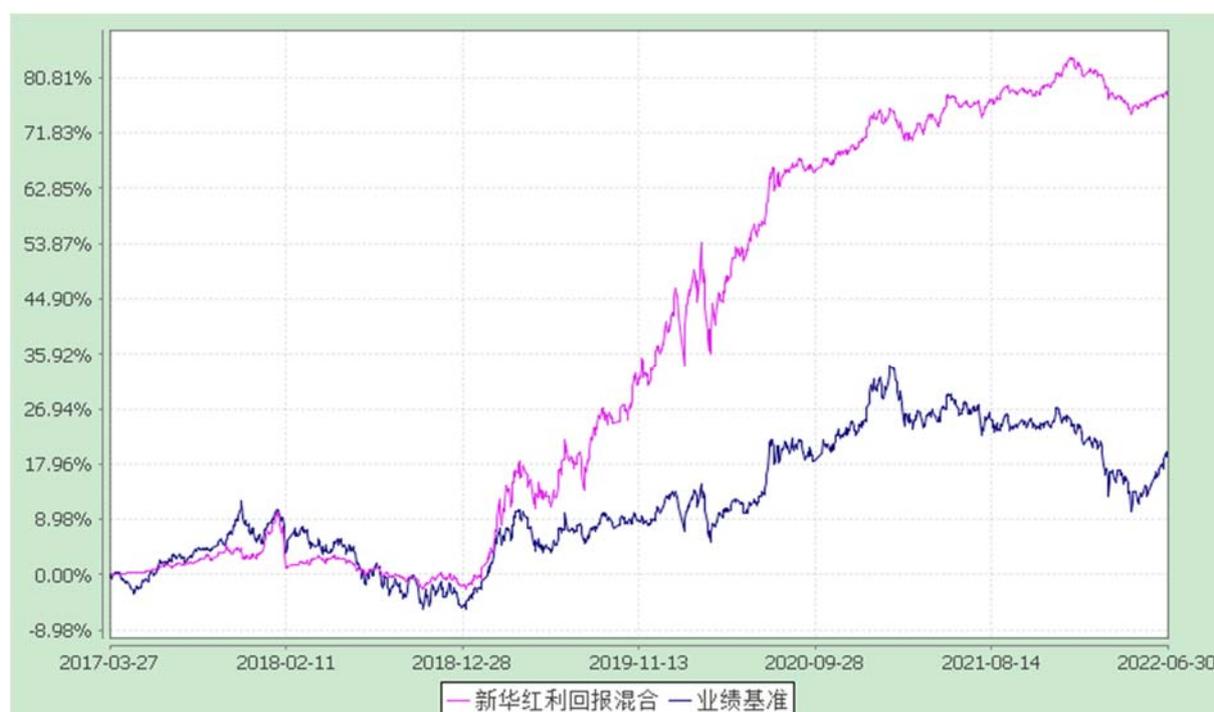
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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 2022 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 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 | | |
| 郑毅 | 本基金基金经理，总经理助理兼固定收益投资部总监，新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理、新华增盈回报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。 | 2021-12-30 | - | 11 | 学士。历任天风证券股份有限公司固定收益总部交易员、固收投资部副总经理、资管分公司策略投资一部总经理、资管分公司总经理助理。 |
| 姚海明 | 本基金基金经理，新华聚利债券型证券投资基金基金经理。 | 2021-12-30 | - | 9 | 会计学硕士，历任中国工商银行总行资产管理部交易员，新华基金固定收益与平衡投资部债券研究员、基金经理助理、投资经理。 |
| 于航 | 本基金基金经理助理，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 | 2020-06-03 | - | 7 | 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。 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | <p>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 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、新华安享 惠金定期开放 债券型证券投 资基金基金经 理助理、新华 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</p> | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

| | | | | | |
|-----|---|------------|---|---|------------------------------------|
| | 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、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。 | | | | |
| 李晓然 | 本基金基金经理助理，新华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、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 | 2022-05-19 | - | 9 | 金融与投资硕士，历任大公国际资信评估有限公司分析师、行业组长、经理。 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | <p>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、新华安享惠融 88 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、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华利率债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</p> | | | | |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|----|--|------------|---|---|------------------------------|
| | 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、新华鑫回报混合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。 | | | | |
| 裴铎 | 本基金基金经理助理，新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券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、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数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、新华安康多元收益一 | 2022-05-19 | - | 6 | 国际经济学硕士，历任广发银行金融市场部交易员、投资经理。 |

| | | | | | |
|-----|---|-----------|------------|---|-----------------|
| | 年持有期混合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、新华丰利债券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、新华增怡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、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。 | | | | |
| 张乃先 | 本基金基金经 | 2020-06-0 | 2022-04-21 | 6 | 经济学硕士,历任新华基金固定收 |

| | | | | | |
|--|--|---|--|--|-----------------------|
| | 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、新华鼎利债券型证券投资基 | 3 | | | 益信用研究员、宏观研究员、高级宏观研究员。 |
|--|--|---|--|--|-----------------------|

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | 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、新华安享多裕定期开放灵活配置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》、《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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年海外市场波动加剧，前期货币放水的副作用已经显现，全球通胀抬升显著，地缘政治紧张局势持续，能源危机和粮食危机已经开始对部分经济体的经济、社会和政治产生强烈而深远的影响，欧美等主要经济体央行都加快了加息步伐。上半年国内疫情防控形势严峻，无论是服务业还是制造业均面临着复苏难题，消费疲弱，出口韧性较强，基建投资发力低于预期，地产投资压力巨大，尤其是部分民营地产公司融资能力受限，尽管货币政策持续宽松但是信用扩张节奏仍较慢，银行间流动性十分充裕，大量流动性外溢到资本市场，A 股在 5 月和 6 月走出了罕见的独立行情。

2022 年上半年我国利率债收益率曲线未进一步延续 2021 年四季度的下行趋势，在短暂探底后，整体呈现区间震荡走势。以 10 年期国债为例，债券到期收益率在上半年最高录得 2.85%，最低录得 2.68%，曲线在区间内震荡。2022 年上半年信用债违约规模同比有所下降，违约债券集中在房地产行业，民营房企的信用环境有所恶化，国企融资优势显著。城投债虽未发生实质违约，但是市场已经给予差异化定价。资产荒背景下，高评级好资质信用债利差压缩至极低水平，流动性溢价和拉长久期成为提高票息主要方式。上半年我们债券投资按照中短久期高评级信用债和中长久期利率债构

建哑铃型债券组合，在规避了信用风险的同时充分享受了收益率震荡下行所带来的超额收益，期间小仓位参与波段操作也适度增厚了组合收益。

2022 年上半年可转债市场表现出非常好的抗跌性，在正股调整最严重的阶段，转债通过被动估值抬升以获得更低的回撤，但是盈亏同源，正股在大幅反弹的时候，转债涨幅也有限，主要表现为估值压缩。转债正股以中证 500 和中证 1000 成分的中小盘股票为主，因此在反弹中后期，资金重新返回市场后，中小盘又会快速被拉升，转债所含的期权价值在波动加大后会得到提升。国内流动性持续宽松是转债行情的核心支撑，如果有迹象表明货币政策边际收紧，市场调整风险会很大。上半年我们通过投资银行类大票转债规避了前期的下跌，但是后期的小票反弹行情也有错过，后续仍要加大对转债的研究和布局。

2022 年上半年 A 股整体呈现“V”形反转走势，今年前 4 个月在国内疫情反复、经济基本面走弱、汇率大幅贬值、外资预期悲观和上市公司业绩暴雷等多重利空因素下，A 股走势很弱且成交量萎缩，4 月底上证指数跌破 3000 点整数关口。但是 5 月开始到 6 月末，上证指数短短数日就重返 3000 点，此后一路向上触及 3400 点，其间从未出现超过 2 个交易日的大幅回撤，A 股日成交额也重回万亿元，在海外股市普遍下跌的背景下，A 股走出了独立行情。上半年 A 股一级行业当中只有煤炭行业上涨且涨幅达 30%以上，而电子、计算机、传媒和军工等传统 TMT 行业跌幅超过 20%，另外中游制造业普遍下跌幅度较大，机械设备、轻工制造、钢铁、家电等行业跌幅也都在 10%以上。上半年我们股票组合配置相对均衡，并没有在行业和风格上过度暴露，1-4 月份的股市快速下跌过程中表现出较强的抗跌性，5-6 月份的反弹行情中，汽车、新能源、军工、半导体等赛道股开始发力上涨甚至突破前期高点，结构性行情十分显著，组合持仓中部分稳增长和低估值高分红等品种虽然年初表现出抗跌性，但是在反弹行情中滞涨跑输大盘，如何在巨大的波动行情中平衡好回撤控制和获取收益，这是我们未来要积极研究和改进的。

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 1.1559 元，本报告期份额净值增长率为-2.58%，同期比较基准的增长率为-4.56%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前外围局势愈加复杂，地缘事件对峙局势继续僵持，地缘政治危机和全球粮食危机可能会成为未来一段时间世界经济面临的重大挑战，经济衰退预期逐渐发酵，全球通胀共振可能性加大，这会在一定程度上限制国内货币政策进一步宽松。随着国内疫情防控取得显著效果，未来主要关注服务业和制造业的复苏，保增长保就业的目标充满挑战，主要在于房地产这个传统稳增长抓手在本轮

刺激中动力不足，保交楼和防断供逐步成为市场的关切点，而仅依靠刺激汽车和家电等耐用品的消费并不足以短期内稳住经济大盘。可以确定的是经济压力最大的阶段已经过去，目前仍处于信用扩张初期，货币市场维持宽松，信贷结构逐步从票据向中长期贷款转化，汇率快速大幅贬值也有利于稳住外贸，出口韧性较强，但是逐渐抬头的通货膨胀始终是货币政策进一步发力的重要掣肘。

A 股在上半年经历了快速下跌和强力反弹，市场情绪得到释放，市场信心也逐渐回升。随着部分赛道股重回高点，大盘指数在成交放量中也屡屡攀升，究竟是大盘在天量成交基础上不断突破形成“水牛”行情，还是会被经济基本面拖回地面经历调整，市场分歧加大。上市公司半年报业绩会在 8 月底前陆续公布，先“交卷”的一般都是优等生，一般会在中报期前期带给市场惊喜和信心，但是考虑到今年二季度的经济形势，大量公司的半年报业绩可能会低于预期从而导致下修全年业绩预期。在这轮的反弹行情中，资金活跃度提高，很多赛道股和小市值股票的股价是随着主题贝塔起来，股价并没有充分反映其业绩情况。上半年大批上市公司所经历的困难和艰辛，正是市场帮投资者做了一场成本高昂的压力测试，我们所要做的就是紧密跟踪市场，筛选基本面扎实、业绩受损预期可控、长期逻辑不断得到验证的投资标的进行布局。

由于目前经济基本面也面临增长乏力的困境，货币政策十分宽松，流动性过剩和资产荒现象显现，债券收益率维持在历史底部区间，进一步下行空间较为有限。往后看疫情影响边际减弱，复工复产已在全国推开，消费逐步恢复正常，基建开工强度加大，叠加汇率贬值，出口韧性强，各地房地产政策不断放松，信用扩张相关数据会逐月得到验证，通胀抬头继续，利率风险开始累积。但是考虑到经济增速中枢下移，如果未来收益率有大幅上行，我们可以考虑适度增加组合久期水平。由于固收+策略产品规模快速扩容，机构资金逐步加码转债资产，导致转债市场交易比较拥挤，前期股票市场下跌时转债并没有顺势调整，导致转股溢价率被动抬升过高，转债价格仍存在压缩估值的空间和必要性，转债市场的战略性配置机会仍未到来，我们会在新上市标的和正股弹性较高的方向积极挖掘寻找投资机会。

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

本基金本报告期无利润分配。

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 2022 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。

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：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 | 7,529,101.38 | 10,873,030.50 |
| 结算备付金 | | 4,099,166.71 | - |
| 存出保证金 | | 35,309.56 | 15,583.44 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 399,531,553.58 | 570,135,835.40 |
| 其中：股票投资 | | 47,390,114.10 | 126,646,713.80 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 352,141,439.48 | 443,489,121.60 |
| 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 | | 163,610.24 | 75,393.22 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,870.09 | 131,012.93 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 7,319,561.95 |
| 资产总计 | | 411,360,611.56 | 588,550,417.44 |
| 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 | | 48,817,709.04 | 28,024,865.99 |
| 应付清算款 | | 111,842.78 | - |
| 应付赎回款 | | 2,296,392.33 | 3,559,118.52 |
| 应付管理人报酬 | | 458,712.79 | 748,229.31 |
| 应付托管费 | | 76,452.13 | 124,704.88 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 23,383.32 | 32,495.77 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 393,312.42 | 319,171.02 |
| 负债合计 | | 52,177,804.81 | 32,808,585.49 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 310,745,786.57 | 468,388,718.62 |

| | | | |
|----------|----------|----------------|----------------|
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.11 | 48,437,020.18 | 87,353,113.33 |
| 净资产合计 | | 359,182,806.75 | 555,741,831.95 |
| 负债和净资产总计 | | 411,360,611.56 | 588,550,417.44 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.1559 元,基金份额总额 310,745,786.57 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：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 | | -8,269,445.68 | 18,963,528.42 |
| 1.利息收入 | | 31,650.57 | 6,432,560.77 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.12 | 22,940.39 | 31,580.30 |
| 债券利息收入 | | - | 6,400,870.42 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 8,710.18 | 110.05 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -8,174,443.80 | 26,745,614.13 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.13 | -21,502,219.30 | 22,344,294.64 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 12,997,802.21 | 3,305,506.94 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | -5,901.75 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 335,875.04 | 1,095,812.55 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | -177,072.05 | -15,059,979.02 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | 50,419.60 | 845,332.54 |
| 减：二、营业总支出 | | 4,382,886.93 | 6,431,308.39 |
| 1. 管理人报酬 | | 3,191,042.69 | 4,223,116.78 |
| 2. 托管费 | | 531,840.44 | 703,852.73 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 512,742.83 | 1,029,972.84 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 512,742.83 | 1,029,972.84 |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|-----------------------|----------------------|
| 7. 税金及附加 | | 18,621.83 | 11,015.03 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.22 | 128,639.14 | 463,351.01 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -12,652,332.61 | 12,532,220.03 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -12,652,332.61 | 12,532,220.03 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -12,652,332.61 | 12,532,220.03 |

6.3 净资产（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：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） | 468,388,718.62 | - | 87,353,113.33 | 555,741,831.95 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 468,388,718.62 | - | 87,353,113.33 | 555,741,831.95 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -157,642,932.05 | - | -38,916,093.15 | -196,559,025.20 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -12,652,332.61 | -12,652,332.61 |
| （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） | -157,642,932.05 | - | -26,263,760.54 | -183,906,692.59 |
| 其中：1.基金申购款 | 4,186,119.32 | - | 727,710.26 | 4,913,829.58 |
| 2.基金赎回款 | -161,829,051.37 | - | -26,991,470.80 | -188,820,522.17 |
| （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） | 310,745,786.57 | - | 48,437,020.18 | 359,182,806.75 |
| 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） | 682,492,828.27 | - | 147,191,395.39 | 829,684,223.66 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 682,492,828.27 | - | 147,191,395.39 | 829,684,223.66 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 34,901,120.51 | - | -44,775,644.00 | -9,874,523.49 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 12,532,220.03 | 12,532,220.03 |
| （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） | 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 |
| （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） | - | - | -66,910,072.05 | -66,910,072.05 |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 717,393,948.78 | - | 102,415,751.39 | 819,809,700.17 |

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 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，按照财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）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》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协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

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 | 7,529,101.38 |
| 等于：本金 | 7,528,364.98 |
| 加：应计利息 | 736.40 |
| 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 | 7,529,101.38 |

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 | | 43,733,523.95 | - | 47,390,114.10 | 3,656,590.15 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 12,845,613.46 | 175,499.65 | 13,139,904.12 | 118,791.01 |
| | 银行间市场 | 332,927,130.77 | 5,910,535.36 | 339,001,535.36 | 163,869.23 |
| | 合计 | 345,772,744.23 | 6,086,035.01 | 352,141,439.48 | 282,660.24 |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 389,506,268.18 | 6,086,035.01 | 399,531,553.58 | 3,939,250.39 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

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

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

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 | 894.23 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 284,239.24 |
| 其中：交易所市场 | 266,581.84 |
| 银行间市场 | 17,657.40 |
| 应付利息 | - |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 上海证券报 | 59,507.37 |
| 审计费 | 39,671.58 |
| 合计 | 393,312.42 |

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 | 468,388,718.62 | 468,388,718.62 |
| 本期申购 | 4,186,119.32 | 4,186,119.32 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -161,829,051.37 | -161,829,051.37 |
| 本期末 | 310,745,786.57 | 310,745,786.57 |

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 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 | 86,748,762.07 | 604,351.26 | 87,353,113.33 |
| 本期利润 | -12,475,260.56 | -177,072.05 | -12,652,332.61 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -27,008,728.30 | 744,967.76 | -26,263,760.54 |
| 其中：基金申购款 | 733,615.11 | -5,904.85 | 727,710.26 |
| 基金赎回款 | -27,742,343.41 | 750,872.61 | -26,991,470.80 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 47,264,773.21 | 1,172,246.97 | 48,437,020.18 |

6.4.7.12 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 | 15,381.06 |
| 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 | 7,559.33 |
| 其他 | - |
| 合计 | 22,940.39 |

注：结算备付金利息包含存出保证金利息。

6.4.7.13 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额 | 201,638,244.27 |
| 减：卖出股票成本总额 | 222,640,471.66 |
| 减：交易费用 | 499,991.91 |
| 买卖股票差价收入 | -21,502,219.30 |

6.4.7.14 基金投资收益

本基金本报告期末产生基金投资。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 7,110,739.12 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 5,887,063.09 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 12,997,802.21 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 642,896,004.40 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 625,472,714.87 |
| 减：应计利息总额 | 11,526,128.59 |
| 减：交易费用 | 10,097.85 |
| 买卖债券差价收入 | 5,887,063.09 |

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 股指期货投资收益 | -5,901.75 |

6.4.7.19 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 | 335,875.04 |

| | |
|---------------|------------|
| 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 | 335,875.04 |

6.4.7.20 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 | -177,072.05 |
| ——股票投资 | 7,371,192.25 |
| ——债券投资 | -7,548,264.30 |
| ——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 | -177,072.05 |

6.4.7.21 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 | 49,605.75 |
| 补差费收入 | 813.85 |
| 合计 | 50,419.60 |

6.4.7.22 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 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 10,860.19 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 上海证券报 | 59,507.37 |
| 查询费 | 300.00 |
| 其他费用 | 300.00 |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 128,639.14 |
|----|------------|

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 2022 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 |
|--------------|-----------|
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 新华基金管理股份有限公司 | 基金管理人、发起人 |
| 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 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 | 23,775,477.86 | 7.12% | 6,438,269.74 | 3.32% |

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 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 | 42,114,147.76 | 56.93% | 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 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 | 22,450,000.00 | 35.30% | 5,600,000.00 | 8.85% |

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 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
|------------|---------------------------------|------------|----------|--------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 恒泰证券股份有限公司 | 17,386.68 | 6.64% | 8,985.04 | 3.37% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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% |

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 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 | 3,191,042.69 | 4,223,116.78 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,557,316.15 | 2,057,635.64 |

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 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 | 531,840.44 | 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 | |
|--------------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
| | 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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 7,529,101.38 | 15,381.06 | 18,879,546.80 | 30,270.99 |

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

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 | 受限期 | 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 |
| 688223 | 晶科能源 | 2022-01-19 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 5.00 | 14.47 | 56,303.00 | 281,515.00 | 814,704.41 | - |
| 688173 | 希荻微 | 2022-01-13 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 33.57 | 31.62 | 4,236.00 | 142,202.52 | 133,942.32 | - |
| 301201 | 诚达药业 | 2022-01-12 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 72.69 | 71.54 | 353.00 | 25,659.57 | 25,253.62 | - |
| 301217 | 铜冠铜箔 | 2022-01-20 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 17.27 | 14.83 | 1,514.00 | 26,146.78 | 22,452.62 | - |
| 30112 | 采纳 | 2022-0 | 1-6个月(含) | 新股 | 50.31 | 70.37 | 301.00 | 15,143.00 | 21,181.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|----------|--------|-------|-------|--------|-----------|-----------|---|
| 2 | 股份 | 1-19 | 月(含) | 锁定期内 | | | | .31 | .37 | |
| 301206 | 三元生物 | 2022-01-26 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 72.87 | 45.69 | 396.00 | 28,855.20 | 18,093.24 | - |
| 301235 | 华康医疗 | 2022-01-21 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 39.30 | 37.93 | 418.00 | 16,427.40 | 15,854.74 | - |
| 301207 | 华兰疫苗 | 2022-02-10 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 56.88 | 56.42 | 281.00 | 15,983.28 | 15,854.02 | - |
| 301123 | 奕东电子 | 2022-01-14 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 37.23 | 25.39 | 532.00 | 19,806.36 | 13,507.48 | - |
| 301116 | 益客食品 | 2022-01-10 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 11.40 | 20.46 | 577.00 | 6,577.80 | 11,805.42 | - |
| 300834 | 星辉环材 | 2022-01-06 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 55.57 | 30.03 | 369.00 | 20,505.33 | 11,081.07 | - |
| 301196 | 唯科科技 | 2022-01-04 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 64.08 | 37.52 | 211.00 | 13,520.88 | 7,916.72 | - |
| 301181 | 标榜股份 | 2022-02-11 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 40.25 | 30.59 | 257.00 | 10,344.25 | 7,861.63 | - |
| 301158 | 德石股份 | 2022-01-07 | 1-6个月(含) | 新股锁定期内 | 15.64 | 20.38 | 379.00 | 5,927.56 | 7,724.02 | - |

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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 47,817,709.04 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|--------|----------|------------|--------|------------|---------------|
| 190208 | 19 国开 08 | 2022-07-01 | 101.95 | 284,000.00 | 28,953,800.00 |
| 210408 | 21 农发 08 | 2022-07-01 | 100.61 | 200,000.00 | 20,122,000.00 |

| | | | | | |
|----|--|--|--|------------|---------------|
| 合计 | | | | 484,000.00 | 49,075,800.00 |
|----|--|--|--|------------|---------------|

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金从事交易所市场债券正回购形成的卖出回购金融资产余额为 1,000,000.00 元，于 2022 年 7 月 1 日全部到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金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 2022年6月30日 | 上年末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 18,360,069.31 | 230,728,000.00 |
| 合计 | 18,360,069.31 | 230,728,000.00 |

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2022年6月30日 | 上年末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA | 145,454,652.28 | 94,069,121.60 |
| AAA 以下 | 94,418,876.79 | 0.00 |
| 未评级 | 93,907,841.10 | 118,692,000.00 |
| 合计 | 333,781,370.17 | 212,761,121.60 |

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 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 | 7,529,101.38 | - | - | - | 7,529,101.38 |
| 结算备付金 | 4,099,166.71 | - | - | - | 4,099,166.71 |
| 存出保证金 | 35,309.56 | - | - | - | 35,309.56 |
| 交易性金融资产 | 253,347,993.71 | 98,793,445.77 | 0.00 | 47,390,114.10 | 399,531,553.58 |
| 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 | - | - | - | 163,610.24 | 163,610.24 |
| 应收股利 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,870.09 | 1,870.09 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 265,011,571.36 | 98,793,445.77 | 0.00 | 47,555,594.43 | 411,360,611.56 |
| 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 | 48,817,709.04 | - | - | - | 48,817,709.04 |
| 应付清算款 | - | - | - | 111,842.78 | 111,842.78 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,296,392.33 | 2,296,392.33 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 458,712.79 | 458,712.79 |
| 应付托管费 | - | - | - | 76,452.13 | 76,452.13 |
| 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 | - | - | - | 23,383.32 | 23,383.32 |
| 应付利润 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 递延所得税负债 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 393,312.42 | 393,312.42 |
| 负债总计 | 48,817,709.04 | 0.00 | 0.00 | 3,360,095.77 | 52,177,804.81 |
| 利率敏感度缺口 | 216,193,862.32 | 98,793,445.77 | 0.00 | 44,195,498.66 | 359,182,806.75 |
| 上年度末 2021 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 | 10,873,030.50 | - | - | - | 10,873,030.50 |
| 结算备付金 | 0.00 | - | - | - | 0.00 |
| 存出保证金 | 15,583.44 | - | - | - | 15,583.44 |
| 交易性金融资产 | 301,217,000.00 | 18,321,486.00 | 123,950,635.60 | 126,646,713.80 | 570,135,835.40 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 75,393.22 | 75,393.22 |
| 应收利息 | - | - | - | 7,319,561.95 | 7,319,561.95 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 131,012.93 | 131,012.93 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 312,105,613.94 | 18,321,486.00 | 123,950,635.60 | 134,172,681.90 | 588,550,417.44 |
| 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 | 28,024,865.99 | - | - | - | 28,024,865.99 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 3,559,118.52 | 3,559,118.52 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 748,229.31 | 748,229.31 |
| 应付托管费 | - | - | - | 124,704.88 | 124,704.88 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 103,276.59 | 103,276.59 |
| 应交税费 | - | - | - | 32,495.77 | 32,495.77 |
| 应付利息 | - | - | - | 4,256.45 | 4,256.45 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 211,637.98 | 211,637.98 |
| 负债总计 | 28,024,865.99 | 0.00 | 0.00 | 4,783,719.50 | 32,808,585.49 |
| 利率敏感度缺口 | 284,080,747.95 | 18,321,486.00 | 123,950,635.60 | 129,388,962.40 | 555,741,831.95 |

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 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| | 市场利率上升 25.00 bp | -828,572.69 | -2,454,680.22 |
| | 市场利率下降 25.00 bp | 760,316.38 | 2,503,958.71 |

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 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 | 47,390,114.10 | 13.19 | 126,646,713.80 | 22.79 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 352,141,439.48 | 98.04 | 443,489,121.60 | 79.80 |
| 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 | 399,531,553.58 | 111.23 | 570,135,835.40 | 102.59 |

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 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| | 沪深 300 指数上升 1% | 488,219.25 | 1,125,424.89 |
| | 沪深 300 指数下降 1% | -488,219.25 | -1,125,424.89 |

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 | 50,730,552.36 |
| 第二层次 | 347,673,768.54 |
| 第三层次 | 1,127,232.68 |
| 合计 | 399,531,553.58 |

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

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 | 47,390,114.10 | 11.52 |
| | 其中：股票 | 47,390,114.10 | 11.52 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 352,141,439.48 | 85.60 |
| | 其中：债券 | 352,141,439.48 | 85.60 |
| | 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 | 11,628,268.09 | 2.83 |
| 8 | 其他各项资产 | 200,789.89 | 0.05 |
| 9 | 合计 | 411,360,611.56 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 1,165,500.00 | 0.32 |
| C | 制造业 | 29,292,671.23 | 8.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,849,600.00 | 0.51 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| E | 建筑业 | 2,250,045.81 | 0.63 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,573,650.00 | 0.44 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,511,702.32 | 0.70 |
| J | 金融业 | 1,955,800.00 | 0.54 |
| K | 房地产业 | 2,330,200.00 | 0.65 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,460,944.74 | 1.24 |
| 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 | 47,390,114.10 | 13.19 |

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股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 002129 | TCL 中环 | 47,000 | 2,767,830.00 | 0.77 |
| 2 | 002555 | 三七互娱 | 112,000 | 2,377,760.00 | 0.66 |
| 3 | 603859 | 能科科技 | 78,000 | 2,368,080.00 | 0.66 |
| 4 | 002001 | 新 和 成 | 100,424 | 2,290,671.44 | 0.64 |
| 5 | 601689 | 拓普集团 | 33,000 | 2,258,190.00 | 0.63 |
| 6 | 002643 | 万润股份 | 104,900 | 2,188,214.00 | 0.61 |
| 7 | 600884 | 杉杉股份 | 70,000 | 2,080,400.00 | 0.58 |
| 8 | 300416 | 苏试试验 | 84,500 | 2,077,010.00 | 0.58 |
| 9 | 603855 | 华荣股份 | 77,000 | 1,963,500.00 | 0.55 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 77,000 | 1,955,800.00 | 0.54 |
| 11 | 600887 | 伊利股份 | 50,000 | 1,947,500.00 | 0.54 |
| 12 | 600900 | 长江电力 | 80,000 | 1,849,600.00 | 0.51 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 13 | 601669 | 中国电建 | 225,063 | 1,771,245.81 | 0.49 |
| 14 | 600031 | 三一重工 | 90,000 | 1,715,400.00 | 0.48 |
| 15 | 600048 | 保利发展 | 95,000 | 1,658,700.00 | 0.46 |
| 16 | 600519 | 贵州茅台 | 700 | 1,431,500.00 | 0.40 |
| 17 | 600309 | 万华化学 | 14,000 | 1,357,860.00 | 0.38 |
| 18 | 000333 | 美的集团 | 22,000 | 1,328,580.00 | 0.37 |
| 19 | 300587 | 天铁股份 | 62,000 | 1,266,660.00 | 0.35 |
| 20 | 600285 | 羚锐制药 | 100,000 | 1,253,000.00 | 0.35 |
| 21 | 600690 | 海尔智家 | 45,094 | 1,238,281.24 | 0.34 |
| 22 | 601088 | 中国神华 | 35,000 | 1,165,500.00 | 0.32 |
| 23 | 601006 | 大秦铁路 | 155,000 | 1,021,450.00 | 0.28 |
| 24 | 002597 | 金禾实业 | 20,000 | 866,600.00 | 0.24 |
| 25 | 300363 | 博腾股份 | 10,500 | 818,895.00 | 0.23 |
| 26 | 688223 | 晶科能源 | 56,303 | 814,704.41 | 0.23 |
| 27 | 000999 | 华润三九 | 18,000 | 810,000.00 | 0.23 |
| 28 | 601799 | 星宇股份 | 4,000 | 684,000.00 | 0.19 |
| 29 | 001979 | 招商蛇口 | 50,000 | 671,500.00 | 0.19 |
| 30 | 601816 | 京沪高铁 | 110,000 | 552,200.00 | 0.15 |
| 31 | 601668 | 中国建筑 | 90,000 | 478,800.00 | 0.13 |
| 32 | 688173 | 希荻微 | 4,236 | 133,942.32 | 0.04 |
| 33 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.01 |
| 34 | 301201 | 诚达药业 | 353 | 25,253.62 | 0.01 |
| 35 | 301217 | 铜冠铜箔 | 1,514 | 22,452.62 | 0.01 |
| 36 | 301122 | 采纳股份 | 301 | 21,181.37 | 0.01 |
| 37 | 301206 | 三元生物 | 396 | 18,093.24 | 0.01 |
| 38 | 301235 | 华康医疗 | 418 | 15,854.74 | 0.00 |
| 39 | 301207 | 华兰疫苗 | 281 | 15,854.02 | 0.00 |
| 40 | 301123 | 奕东电子 | 532 | 13,507.48 | 0.00 |
| 41 | 301116 | 益客食品 | 577 | 11,805.42 | 0.00 |
| 42 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.00 |
| 43 | 300834 | 星辉环材 | 369 | 11,081.07 | 0.00 |
| 44 | 301196 | 唯科科技 | 211 | 7,916.72 | 0.00 |
| 45 | 301181 | 标榜股份 | 257 | 7,861.63 | 0.00 |
| 46 | 301158 | 德石股份 | 379 | 7,724.02 | 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 | 300059 | 东方财富 | 4,318,775.14 | 0.78 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 2 | 300587 | 天铁股份 | 4,024,764.00 | 0.72 |
| 3 | 601689 | 拓普集团 | 3,926,750.00 | 0.71 |
| 4 | 300413 | 芒果超媒 | 3,401,310.00 | 0.61 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 3,249,263.21 | 0.58 |
| 6 | 000739 | 普洛药业 | 3,185,424.00 | 0.57 |
| 7 | 002756 | 永兴材料 | 3,008,084.00 | 0.54 |
| 8 | 600745 | 闻泰科技 | 2,915,257.00 | 0.52 |
| 9 | 600309 | 万华化学 | 2,782,870.00 | 0.50 |
| 10 | 603859 | 能科科技 | 2,705,166.00 | 0.49 |
| 11 | 601668 | 中国建筑 | 2,575,140.00 | 0.46 |
| 12 | 002960 | 青鸟消防 | 2,539,249.00 | 0.46 |
| 13 | 300726 | 宏达电子 | 2,498,679.00 | 0.45 |
| 14 | 000977 | 浪潮信息 | 2,308,150.54 | 0.42 |
| 15 | 002585 | 双星新材 | 2,236,203.00 | 0.40 |
| 16 | 603613 | 国联股份 | 2,221,582.00 | 0.40 |
| 17 | 002129 | TCL 中环 | 2,216,714.00 | 0.40 |
| 18 | 601669 | 中国电建 | 2,148,748.00 | 0.39 |
| 19 | 600690 | 海尔智家 | 2,102,396.74 | 0.38 |
| 20 | 600905 | 三峡能源 | 2,079,120.00 | 0.37 |

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 | 300413 | 芒果超媒 | 6,876,239.00 | 1.24 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 5,449,167.00 | 0.98 |
| 3 | 601899 | 紫金矿业 | 5,447,693.00 | 0.98 |
| 4 | 000002 | 万科 A | 4,324,053.00 | 0.78 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 4,312,426.00 | 0.78 |
| 6 | 601225 | 陕西煤业 | 4,206,759.00 | 0.76 |
| 7 | 600309 | 万华化学 | 4,103,167.00 | 0.74 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 3,856,471.00 | 0.69 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 3,586,495.00 | 0.65 |
| 10 | 300251 | 光线传媒 | 3,515,203.00 | 0.63 |
| 11 | 300059 | 东方财富 | 3,319,732.58 | 0.60 |
| 12 | 300284 | 苏交科 | 3,272,622.56 | 0.59 |
| 13 | 600383 | 金地集团 | 3,261,076.00 | 0.59 |
| 14 | 600660 | 福耀玻璃 | 3,246,445.00 | 0.58 |
| 15 | 600048 | 保利发展 | 3,104,023.00 | 0.56 |
| 16 | 300587 | 天铁股份 | 3,101,870.30 | 0.56 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 17 | 000999 | 华润三九 | 3,060,474.21 | 0.55 |
| 18 | 601799 | 星宇股份 | 3,055,039.00 | 0.55 |
| 19 | 300788 | 中信出版 | 2,953,697.00 | 0.53 |
| 20 | 001979 | 招商蛇口 | 2,949,259.00 | 0.53 |

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 | 136,012,679.71 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 201,638,244.27 |

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 | 18,292,935.07 | 5.09 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 93,974,975.34 | 26.16 |
| | 其中：政策性金融债 | 93,974,975.34 | 26.16 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 162,422,604.40 | 45.22 |
| 6 | 中期票据 | 72,565,320.00 | 20.20 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 4,885,604.67 | 1.36 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 352,141,439.48 | 98.04 |

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 | 190208 | 19 国开 08 | 600,000 | 63,216,378.08 | 17.60 |
| 2 | 210408 | 21 农发 08 | 200,000 | 20,652,827.40 | 5.75 |
| 3 | 012280654 | 22 赣国资 SCP001 | 200,000 | 20,154,880.00 | 5.61 |
| 4 | 042280071 | 22 龙源电 力 CP001 | 200,000 | 20,148,416.44 | 5.61 |
| 5 | 042280089 | 22 国电 CP001 | 200,000 | 20,137,136.44 | 5.61 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末尚无国债期货投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 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 (一)“杉杉股份”的发行人宁波杉杉股份有限公司收到中国证券监督管理委员会宁波监管局于 2022 年 4 月 13 日出具的[2022]6 号《行政监管措施决定书》: 未及时披露政府补助事项, 违反了《上市公司信息披露管理办法》(证监会令第 182 号) 第三条规定。

(二)“19 国开 08”发行人国家开发银行: 因监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送 17 项违法违规行为, 中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款 440 万元。(银保监罚决字 (2022) 8 号, 2022 年 3 月 21 日)。

(三)“21 农发 08”的发行人中国农业发展银行:
中国农业发展银行因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送 17 项违法违规行为被罚款 480 万元。【银保监罚决字 (2022) 10 号】

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 | 35,309.56 |
| 2 | 应收清算款 | 163,610.24 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,870.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 200,789.89 |

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 | 110053 | 苏银转债 | 2,452,820.46 | 0.68 |
| 2 | 128048 | 张行转债 | 2,014,850.48 | 0.56 |

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 |
| 3,058 | 101,617.33 | 5,318,312.93 | 1.71% | 305,427,473.64 | 98.29% |

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 | 16.20 | 0.00% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|----|-------------------|
|----|-------------------|

| | |
|------------------------------------|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017年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 | 468,388,718.62 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,186,119.32 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 161,829,051.37 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 310,745,786.57 |

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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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

本报告期未有基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 | |
| 长江证券 | 3 | 122,434,034.91 | 36.67% | 96,630.13 | 36.91% | - |
| 天风证券 | 4 | 68,444,205.66 | 20.50% | 50,053.68 | 19.12% | - |
| 德邦证券 | 2 | 26,248,282.27 | 7.86% | 19,195.45 | 7.33% | - |
| 恒泰证券 | 2 | 23,775,477.86 | 7.12% | 17,386.68 | 6.64% | - |
| 海通证券 | 1 | 21,551,223.51 | 6.46% | 20,070.84 | 7.67% | - |
| 华泰证券 | 1 | 20,307,899.04 | 6.08% | 14,851.12 | 5.67% | - |
| 国泰君安 | 1 | 15,816,300.00 | 4.74% | 14,729.53 | 5.63% | - |
| 安信证券 | 1 | 14,481,642.67 | 4.34% | 13,486.71 | 5.15% | - |
| 中信证券 | 3 | 10,534,627.49 | 3.16% | 7,875.38 | 3.01% | - |
| 西南证券 | 1 | 5,822,764.70 | 1.74% | 4,258.24 | 1.63% | - |
| 民生证券 | 2 | 2,399,634.85 | 0.72% | 1,754.84 | 0.67% | - |
| 中山证券 | 1 | 1,270,110.00 | 0.38% | 928.82 | 0.35% | - |
| 开源证券 | 2 | 773,357.68 | 0.23% | 565.52 | 0.22% | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用 40 个交易席位，其中报告期内新增 3 个交易席位，退租 0 个交易席位。新增席位为：天风证券上海席位、天风证券深圳席位、中山证券深圳席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

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

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。

2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员分别打分，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 |
| 长江证券 | 1,844,734.10 | 2.49% | 20,400,000.00 | 32.08% | - | - |
| 天风证券 | 9,364,560.40 | 12.66% | 12,100,000.00 | 19.03% | - | - |
| 德邦证券 | 1,060,800.00 | 1.43% | 3,050,000.00 | 4.80% | - | - |
| 恒泰证券 | 42,114,147.76 | 56.93% | 22,450,000.00 | 35.30% | - | - |
| 海通证券 | 404,720.00 | 0.55% | 5,100,000.00 | 8.02% | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 52,124.60 | 0.07% | - | - | - | - |
| 安信证券 | 17,901,260.34 | 24.20% | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1,235,998.00 | 1.67% | 500,000.00 | 0.79% | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 2022-01-05 |
| 3 | 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 | 2022-01-05 |
| 4 | 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 |
| 5 | 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 |
| 6 | 新华基金管理股份有限公司关于设立上海分公司的公告 | 中国证券报、公司网站、电子信披网站 | 2022-01-13 |
| 7 | 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 |
| 8 | 新华红利回报混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 公司网站、电子信披网站 | 2022-01-21 |
| 9 | 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 | 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 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------------|------------|
| | 的公告 | | |
| 10 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任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 | 2022-02-24 |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中植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 | 2022-03-02 |
| 14 | 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 |
| 15 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中信百信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 | 2022-03-16 |
| 16 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券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 | 2022-03-18 |
| 17 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加和讯信息科技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 | 2022-03-18 |
| 18 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行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 | 2022-03-28 |
| 19 | 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 |
| 20 | 新华红利回报混合型证券投资基金 2021 年年度报告 | 公司网站、电子信披网站 | 2022-03-30 |
| 21 | 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 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------------|------------|
| 22 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海利得基金销售有限公司开展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 | 2022-04-15 |
| 23 | 新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 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 | 2022-04-21 |
| 24 | 新华红利回报混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告 | 公司网站、电子信披网站 | 2022-04-21 |
| 25 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加五矿证券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 | 2022-04-21 |
| 26 | 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 | 2022-05-06 |
| 27 | 新华红利回报混合型证券投资基金基金产品资料概要 | 公司网站、电子信披网站 | 2022-05-06 |
| 28 | 新华基金管理股份有限公司关于部分基金增加博时财富基金销售有限公司作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 | 2022-05-09 |
| 29 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海攀赢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 | 2022-06-09 |

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

二〇二二年八月三十日