新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金
2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十三日

§1 重要提示

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。本年度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 2019 年 8 月 21 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。

本年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新沃通盈灵活配置混合
基金主代码	002564
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日
基金管理人	新沃基金管理有限公司
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	9,192,223.27 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以风险管理为前提，通过把握中国稳增长与促转型的发展现状，灵活运用多种投资策略，挖掘各大类资产配置机会，力求高于业绩比较基准的长期资产增值。
投资策略	本基金在深度把握中国经济发展与转型的基础上，通过自上而下的宏观-中观-微观的资产配置策略，以及自下而上的精选行业、个股的基本面分析策略，再通过定性分析和定量分析互相结合的选股方法，辅以多种事件驱动、量化研究等工具策略，在风险管理的前提下因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产长期增值。
业绩比较基准	65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但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		新沃基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘小舫	郭明
	联系电话	400-698-9988	010-66105799
	电子邮箱	service@sinvofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-698-9988	95588
传真		010-58290555	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.sinvofund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,934,032.42
本期利润	2,353,809.41
加权平均基金份额本期利润	0.1744
本期基金份额净值增长率	19.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0063
期末基金资产净值	9,537,018.71
期末基金份额净值	1.038

注：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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

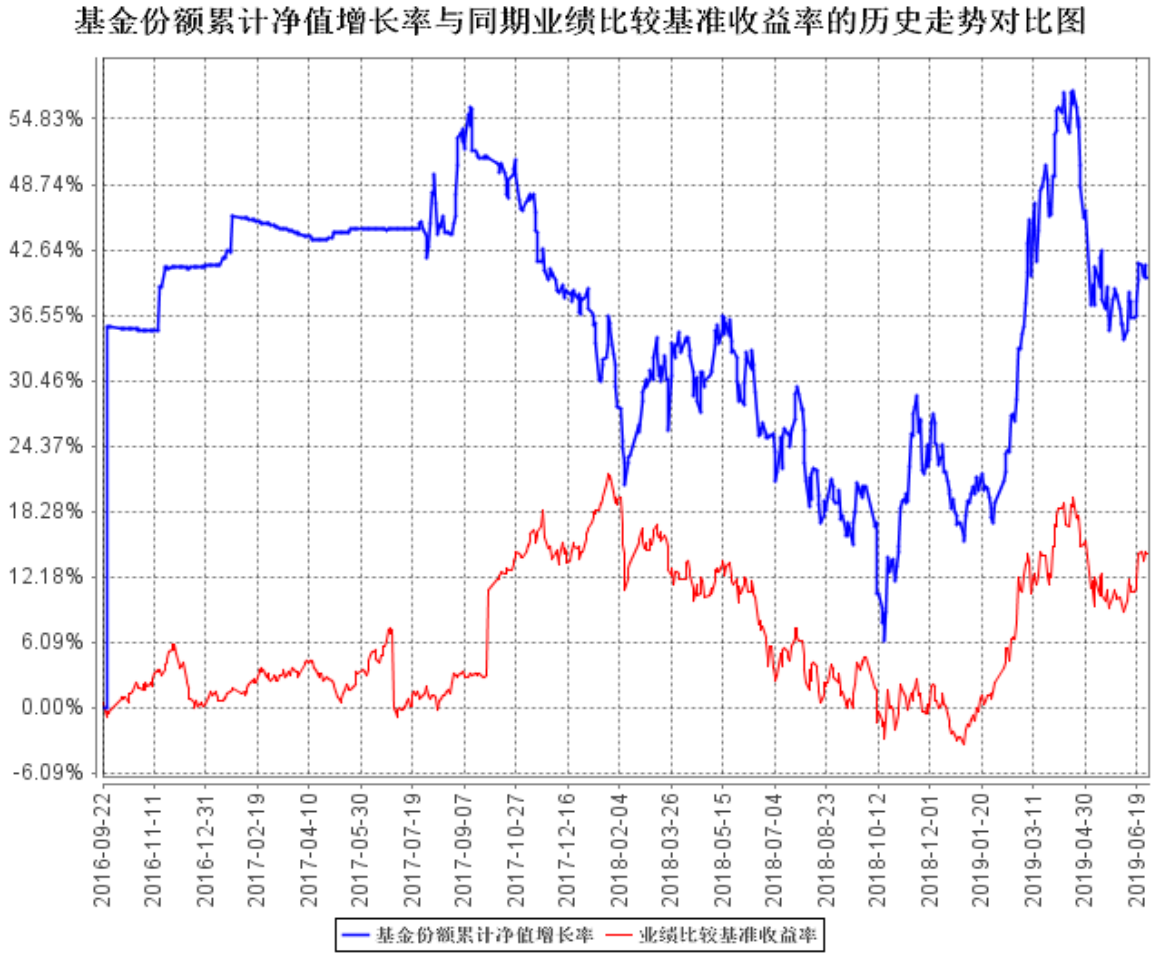
3.2 基金净值表现

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	1.17%	0.98%	3.73%	0.76%	-2.56%	0.22%
过去三个月	-6.32%	1.43%	-0.60%	1.01%	-5.72%	0.42%
过去六个月	19.59%	1.42%	17.46%	1.01%	2.13%	0.41%
过去一年	11.73%	1.42%	8.11%	0.99%	3.62%	0.43%
自基金合同生效起至今	40.06%	1.72%	14.29%	0.84%	25.77%	0.88%

注：本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则，本基金选取“65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率”作为本基金的比较基准。

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



§ 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

新沃基金管理有限公司成立于 2015 年 8 月，是一家经中国证监会核准设立的全国性基金管理公司，注册资本 10,000 万元，具有基金管理资格，经营基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

公司成立以来，公募基金和特定客户资产管理业务均得到较快发展。公司于 2015 年成立了新沃通宝货币市场基金，并于 2016 年成立了新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金、新沃通利纯债债券型证券投资基金和新沃鑫禧债券型证券投资基金，同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

未来，公司将继续秉承“专业创造机会，合作实现价值”的发展理念，坚持“以人为本”的

发展战略，坚守“诚信、专业、合作、超越”的价值准则，致力于经过长期努力跻身国内一流基金管理公司行列，力求为广大投资者提供稳定的投资回报。

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		
俞璨	本基金的基金经理	2018 年 6 月 28 日	-	6 年	复旦大学硕士，中国籍。2013 年 7 月至 2016 年 9 月任职于国金证券，历任证券交易员、投资经理、投资主办；2016 年 10 月加入新沃基金管理有限公司。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

为公平对待投资者，保护投资者利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做出明确具体的规定。本报告期内，本基金管理人严格执行相关规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

本产品在上半年重点配置权益板块，通过量化和基本面结合的方式，积极寻找优质标的，力争获取较高的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.038 元；本报告期基金份额净值增长率为 19.59%，业绩比较基准收益率为 17.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年一季度，经济数据略有起色，市场对于经济企稳的预期有所增强。二季度，经济指标除消费外，基本都低于预期。年初以来，权益资产整体估值较低，安全边际高，中美贸易战的缓和也有利于市场情绪的回暖。市场流动性方面，资金面整体宽松，R007 处于历史相对低位。货币政策信号明确，季末流动性充足，货币基金收益率再创新低。汇率方面，人民币贬值压力缓解，有利于国内资产的估值回升。债券市场方面，机构投资者出现一定的分歧，预期未来仍将维持震荡走势；权益市场则相对更具吸引力。

基本面、风险偏好和流动性继续利好债券市场。债市方面，利率债维持震荡，活跃券估值在 3.65%-3.85%区间徘徊，受到资金面以及基本面的影响，目前债市整体环境良好。权益方面，市场面对的经济状况和预期、对中美贸易摩擦的判断显然都不及 4 月初，短期突破前高的概率不大；7 月中报季可能会带来一定的风险释放，但 2800 仍然是较为确定的底部，进一步下跌概率有限。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1)有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，为建立健全有效的估值政策和程序，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由投资研究部、监察稽核部、基金事务部相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25％以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

(2)基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

(3)本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

(4)定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况；本基金于 2019 年 1 月 2 日至 2019 年 6 月 28 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会报告并提出解决方案，本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§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沃通盈灵活配置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，新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金的管理人——新沃基金管理有限公司在新沃通盈灵活配置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。本报告期内，新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新沃基金管理有限公司编制和披露的新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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：新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	280,318.64	48,359.34
结算备付金		198,807.09	255,747.21
存出保证金		15,447.28	16,383.24
交易性金融资产	6.4.7.2	9,119,567.00	12,534,045.00
其中：股票投资		8,289,147.60	11,801,547.00
基金投资		-	-
债券投资		830,419.40	732,498.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		92,372.49	235,800.05
应收利息	6.4.7.5	10,588.95	20,569.93
应收股利		-	-
应收申购款		1,053.82	4,680.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,718,155.27	13,115,585.74
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2019 年 6 月 30 日**	**上年度末 2018 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		109,132.20	194,681.82
应付赎回款		5,653.70	8,798.46
应付管理人报酬		5,038.45	6,726.62
应付托管费		1,259.61	1,681.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	23,777.52	31,829.79
应交税费		2.00	2.41

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	36,273.08	66,500.00
负债合计		181,136.56	310,220.75
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	9,192,223.27	14,744,848.08
未分配利润	6.4.7.10	344,795.44	-1,939,483.09
所有者权益合计		9,537,018.71	12,805,364.99
负债和所有者权益总计		9,718,155.27	13,115,585.74

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.038 元，基金份额总额 9,192,223.27 份。

6.2 利润表

会计主体：新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,685,626.63	-836,421.81
1.利息收入		17,004.95	23,863.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,501.24	8,107.92
债券利息收入		11,412.43	10,597.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,091.28	5,158.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,224,970.65	-908,017.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,138,958.33	-935,841.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,906.49	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	90,918.81	27,823.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	419,776.99	47,551.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	23,874.04	180.30
减：二、费用		331,817.22	236,164.38
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	40,938.30	32,816.17

2．托管费	6.4.10.2.2	10,234.60	8,204.06
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	234,769.27	136,870.25
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		1.97	2.32
7．其他费用	6.4.7.20	45,873.08	58,271.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,353,809.41	-1,072,586.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,353,809.41	-1,072,586.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,744,848.08	-1,939,483.09	12,805,364.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,353,809.41	2,353,809.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,552,624.81	-69,530.88	-5,622,155.69
其中：1.基金申购款	2,254,619.83	101,034.25	2,355,654.08
2.基金赎回款	-7,807,244.64	-170,565.13	-7,977,809.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	9,192,223.27	344,795.44	9,537,018.71

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,391,129.58	267,392.09	11,658,521.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,072,586.19	-1,072,586.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,309.92	-1,995.24	-5,305.16
其中：1.基金申购款	81,029.88	-2,454.12	78,575.76
2.基金赎回款	-84,339.80	458.88	-83,880.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	11,387,819.66	-807,189.34	10,580,630.32

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：

易勇	易勇	马楠
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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]394 号《关于准予新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由新沃基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 201,825,420.01 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1247 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 22 日正式生效，基

金合同生效日的基金份额总额为 201,825,782.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 362.38 份基金份额。本基金的基金管理人为新沃基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券等)、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，持有的权证合计市值占基金资产的比例为 0%-3%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值 5%。本基金的业绩比较基准为 65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“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<年度报告和半年度报告>》、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》、《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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费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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	280,318.64
定期存款	-
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	-
合计：	280,318.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		8,202,000.99	8,289,147.60	87,146.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	830,934.28	830,419.40	-514.88
	银行间市场	-	-	-
	合计	830,934.28	830,419.40	-514.88
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		9,032,935.27	9,119,567.00	86,631.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	66.76
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	89.50
应收债券利息	10,425.79
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.90
合计	10,588.95

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	23,777.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	23,777.52

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	36,273.08
合计	36,273.08

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,744,848.08	14,744,848.08
本期申购	2,254,619.83	2,254,619.83
本期赎回(以"-"号填列)	-7,807,244.64	-7,807,244.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	9,192,223.27	9,192,223.27

6.4.7.10 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	-1,723,763.14	-215,719.95	-1,939,483.09
本期利润	1,934,032.42	419,776.99	2,353,809.41
本期基金份额交易产生的变动数	-152,677.48	83,146.60	-69,530.88
其中：基金申购款	-8,739.54	109,773.79	101,034.25
基金赎回款	-143,937.94	-26,627.19	-170,565.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,591.80	287,203.64	344,795.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,075.05
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,292.58
其他	133.61
合计	3,501.24

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	152,937,662.21
减：卖出股票成本总额	150,798,703.88
买卖股票差价收入	2,138,958.33

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,906.49
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	-4,906.49

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	733,372.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	710,906.49
减：应收利息总额	27,372.00
买卖债券差价收入	-4,906.49

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	90,918.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	90,918.81

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	419,776.99
——股票投资	418,417.40
——债券投资	1,359.59
——资产支持证券投资	-
——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	419,776.99

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	23,874.04
合计	23,874.04

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，对持有期内的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	234,769.27
银行间市场交易费用	-
合计	234,769.27

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	-
其他手续费	600.00
银行间账户维护费	18,000.00
合计	45,873.08

6.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新沃基金	基金管理人、注册登记机构和基金销售机构
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
新沃资本控股集团有限公司	基金管理人的股东
新沃联合资产管理有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	40,938.30	32,816.17
其中：支付销售机构的客户维护费	1,969.02	134.27

注：支付基金管理人新沃基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，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×0.60%/ 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,234.60	8,204.06

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.15%/ 当年天数。

6.4.9.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（ 2016 年 9 月 22 日 ）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,878,908.13	1,878,908.13
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	1,878,908.13	1,878,908.13
期末持有的基金份额占基金总份额比例	20.44%	16.50%

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未投资本基金。

6.4.9.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	280,318.64	1,075.05	43,344.87	7,023.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按适用利率计息。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.10 期末（ 2019 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002193	如意集团	2019 年 6 月 25 日	因重大事项停牌	8.81	2019 年 7 月 9 日	9.12	4,000	35,000.00	35,240.00	-

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 8,289,147.60 元，属于第二层次的余额为 830,419.40 元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 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。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	8,289,147.60	85.30
	其中：股票	8,289,147.60	85.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	830,419.40	8.55
	其中：债券	830,419.40	8.55
	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	479,125.73	4.93
8	其他各项资产	119,462.54	1.23
9	合计	9,718,155.27	100.00

7.2 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

金额单位：人民币元

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	248,344.00	2.60
C	制造业	4,042,152.60	42.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	632,868.00	6.64
E	建筑业	348,379.00	3.65
F	批发和零售业	332,063.00	3.48
G	交通运输、仓储和邮政业	261,411.00	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	193,148.00	2.03
J	金融业	497,720.00	5.22
K	房地产业	912,243.00	9.57
L	租赁和商务服务业	213,069.00	2.23
M	科学研究和技术服务业	68,499.00	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	281,925.00	2.96

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	158,434.00	1.66
R	文化、体育和娱乐业	67,900.00	0.71
S	综合	30,992.00	0.32
	合计	8,289,147.60	86.92

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

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	300616	尚品宅配	1,700	128,554.00	1.35
2	000619	海螺型材	19,200	105,408.00	1.11
3	600052	浙江广厦	33,600	104,160.00	1.09
4	600854	春兰股份	26,400	103,224.00	1.08
5	002133	广宇集团	30,100	102,641.00	1.08
6	600519	贵州茅台	100	98,400.00	1.03
7	300347	泰格医药	1,200	92,520.00	0.97
8	002439	启明星辰	3,400	91,460.00	0.96
9	603868	飞科电器	2,300	90,045.00	0.94
10	600132	重庆啤酒	1,900	89,604.00	0.94

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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	600519	贵州茅台	1,610,029.00	12.57
2	002032	苏 泊 尔	570,965.00	4.46
3	002682	龙洲股份	544,265.08	4.25
4	600127	金健米业	485,744.00	3.79
5	600189	吉林森工	470,723.00	3.68

6	002286	保龄宝	467,335.00	3.65
7	600016	民生银行	462,540.80	3.61
8	601998	中信银行	459,931.00	3.59
9	600019	宝钢股份	454,291.00	3.55
10	601996	丰林集团	442,378.00	3.45
11	601169	北京银行	441,364.80	3.45
12	603031	安德利	436,274.00	3.41
13	603589	口子窖	417,346.00	3.26
14	002275	桂林三金	412,121.00	3.22
15	000898	鞍钢股份	411,334.00	3.21
16	000809	铁岭新城	410,137.00	3.20
17	600919	江苏银行	400,370.00	3.13
18	002623	亚玛顿	398,367.00	3.11
19	603090	宏盛股份	395,145.00	3.09
20	601229	上海银行	394,214.00	3.08
21	600578	京能电力	388,929.00	3.04
22	300442	普丽盛	387,202.00	3.02
23	300673	佩蒂股份	384,906.00	3.01
24	300235	方直科技	380,557.00	2.97
25	002220	ST 天宝	377,480.00	2.95
26	603725	天安新材	372,681.00	2.91
27	000428	华天酒店	371,330.00	2.90
28	300529	健帆生物	364,643.00	2.85
29	600383	金地集团	358,227.00	2.80
30	601939	建设银行	357,846.48	2.79
31	600000	浦发银行	355,256.00	2.77
32	601988	中国银行	350,980.00	2.74
33	601818	光大银行	350,861.00	2.74
34	600022	山东钢铁	350,101.00	2.73
35	002719	麦趣尔	349,278.00	2.73
36	601088	中国神华	346,747.00	2.71
37	601009	南京银行	340,973.00	2.66
38	600510	黑牡丹	334,513.00	2.61
39	601166	兴业银行	334,478.00	2.61
40	300301	长方集团	323,767.00	2.53
41	000157	中联重科	315,881.00	2.47

42	601328	交通银行	315,074.00	2.46
43	000833	粤桂股份	311,430.00	2.43
44	603986	兆易创新	311,345.00	2.43
45	002916	深南电路	308,600.00	2.41
46	601633	长城汽车	305,010.00	2.38
47	600723	首商股份	297,996.00	2.33
48	600015	华夏银行	297,626.00	2.32
49	002394	联发股份	291,607.00	2.28
50	603139	康惠制药	289,642.00	2.26
51	600104	上汽集团	288,612.00	2.25
52	000709	河钢股份	287,813.00	2.25
53	600475	华光股份	286,309.16	2.24
54	603029	天鹅股份	285,335.00	2.23
55	000719	中原传媒	282,576.00	2.21
56	603001	奥康国际	281,210.00	2.20
57	300669	沪宁股份	278,185.00	2.17
58	002724	海洋王	273,131.00	2.13
59	002824	和胜股份	271,187.00	2.12
60	300550	和仁科技	268,843.00	2.10
61	002561	徐家汇	267,640.00	2.09
62	600188	兖州煤业	267,347.00	2.09
63	600827	百联股份	265,863.00	2.08
64	300656	民德电子	265,499.00	2.07
65	300716	国立科技	263,990.00	2.06
66	000663	永安林业	263,497.00	2.06
67	300426	唐德影视	263,464.00	2.06
68	601288	农业银行	262,846.00	2.05
69	600650	锦江投资	259,024.00	2.02
70	300616	尚品宅配	258,242.00	2.02
71	600011	华能国际	258,084.00	2.02
72	002729	好利来	256,951.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,616,917.00	12.63
2	002032	苏 泊 尔	645,000.00	5.04
3	002682	龙洲股份	577,608.00	4.51
4	603031	安德利	541,289.00	4.23
5	600127	金健米业	507,379.00	3.96
6	600019	宝钢股份	503,983.00	3.94
7	601998	中信银行	482,388.00	3.77
8	600016	民生银行	478,895.00	3.74
9	300442	普丽盛	461,018.00	3.60
10	601169	北京银行	459,936.12	3.59
11	600189	吉林森工	445,131.00	3.48
12	603090	宏盛股份	439,281.00	3.43
13	000898	鞍钢股份	426,808.00	3.33
14	600383	金地集团	424,730.00	3.32
15	600919	江苏银行	424,564.00	3.32
16	300529	健帆生物	424,433.00	3.31
17	601229	上海银行	413,829.00	3.23
18	601996	丰林集团	412,255.00	3.22
19	002275	桂林三金	410,200.00	3.20
20	300235	方直科技	407,253.56	3.18
21	600510	黑牡丹	404,577.00	3.16
22	000809	铁岭新城	402,508.23	3.14
23	002623	亚玛顿	392,527.00	3.07
24	002220	ST 天宝	388,384.00	3.03
25	002286	保龄宝	386,045.00	3.01
26	601939	建设银行	379,973.15	2.97
27	601988	中国银行	373,345.00	2.92
28	603725	天安新材	370,925.00	2.90
29	300673	佩蒂股份	367,557.00	2.87
30	601088	中国神华	366,470.00	2.86
31	601818	光大银行	366,227.00	2.86
32	603589	口子窖	365,918.00	2.86
33	000428	华天酒店	359,374.00	2.81
34	601009	南京银行	356,433.00	2.78
35	601166	兴业银行	356,380.00	2.78
36	300301	长方集团	345,647.00	2.70

37	002719	麦趣尔	340,418.00	2.66
38	600104	上汽集团	340,368.00	2.66
39	601328	交通银行	329,671.00	2.57
40	600000	浦发银行	328,982.00	2.57
41	002916	深南电路	326,842.00	2.55
42	000833	粤桂股份	324,948.00	2.54
43	300330	华虹计通	323,528.40	2.53
44	000157	中联重科	321,014.00	2.51
45	600578	京能电力	315,171.00	2.46
46	600022	山东钢铁	312,456.00	2.44
47	601828	美凯龙	311,316.00	2.43
48	002394	联发股份	310,762.00	2.43
49	603139	康惠制药	309,660.00	2.42
50	002824	和胜股份	308,511.00	2.41
51	603986	兆易创新	307,363.00	2.40
52	600475	华光股份	307,155.96	2.40
53	600188	兖州煤业	306,501.00	2.39
54	601633	长城汽车	304,170.00	2.38
55	000709	河钢股份	303,285.00	2.37
56	600723	首商股份	297,634.00	2.32
57	300656	民德电子	297,049.00	2.32
58	300550	和仁科技	292,381.80	2.28
59	002724	海洋王	291,650.00	2.28
60	600376	首开股份	291,605.00	2.28
61	603866	桃李面包	289,980.00	2.26
62	300669	沪宁股份	287,695.00	2.25
63	603029	天鹅股份	286,805.00	2.24
64	002729	好利来	285,697.00	2.23
65	601997	贵阳银行	284,824.00	2.22
66	300566	激智科技	282,047.80	2.20
67	002110	三钢闽光	281,518.00	2.20
68	600650	锦江投资	277,161.00	2.16
69	603001	奥康国际	272,900.00	2.13
70	300275	梅安森	271,473.00	2.12
71	300650	太龙照明	266,738.40	2.08
72	300426	唐德影视	266,136.00	2.08
73	600015	华夏银行	264,625.00	2.07
74	603887	城地股份	264,368.00	2.06

75	600827	百联股份	263,704.00	2.06
76	603536	惠发股份	263,493.00	2.06
77	000663	永安林业	263,446.00	2.06
78	300716	国立科技	259,513.60	2.03
79	002921	联诚精密	259,147.00	2.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	146,867,887.08
卖出股票收入（成交）总额	152,937,662.21

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	806,761.40	8.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	23,658.00	0.25
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	830,419.40	8.71

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	019608	18 国债 26	4,070	407,081.40	4.27
2	019611	19 国债 01	4,000	399,680.00	4.19
3	127395	16 吉城建	300	23,658.00	0.25

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,447.28
2	应收证券清算款	92,372.49
3	应收股利	-
4	应收利息	10,588.95
5	应收申购款	1,053.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,462.54

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§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
488	18,836.52	7,513,329.76	81.74%	1,678,893.51	18.26%

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	241,536.83	2.6276%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016 年 9 月 22 日 ）基金份额总额	201,825,782.39
本报告期期初基金份额总额	14,744,848.08
本报告期期间基金总申购份额	2,254,619.83
减:本报告期期间基金总赎回份额	7,807,244.64
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	9,192,223.27

§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

本报告期内，本基金管理人、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

本报告期末内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
安信证券	2	100,149,206.36	33.40%	21,160.21	38.32%	-
渤海证券	1	88,144,843.68	29.40%	18,623.62	33.72%	-
财通证券	2	86,244,929.82	28.77%	9,598.84	17.38%	-

联讯证券	1	25,266,569.43	8.43%	5,844.29	10.58%	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《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）的规定及《新沃基金管理有限公司交易席位管理办法》，本基金管理人制定了券商选择标准和租用交易单元的程序，具体如下：

投资研究部按照《券商评估细则》完成对各往来证券经纪商的评估，评估实行评分制：分配权重（100 分）=基础服务（45%）+特别服务（45%）+销售服务（10%）。

基础服务占 45%权重，由研究员负责打分；特别服务占 45%权重，由投资研究部负责人和研究员共同打分；销售服务占 10%权重，由投资研究部负责人打分。

基础服务包括：报告、电话沟通、路演、联合调研服务等；

特别服务包括：深度推荐公司、单独调研、带上市公司上门路演、约见专家、委托课题、人员培养、重大投资机会等；

销售服务包括：日常沟通、重点推荐的沟通、研究投资工作的支持和配合。

根据以上标准对券商进行评估、确定选用交易单元的券商后，本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租赁协议，并通知基金托管人。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
安信证券	-	-	100,000.00	0.65%	-	-
渤海证券	813,643.71	100.00%	15,400,000.00	99.35%	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/01/01-2019/06/30	9,338,052.63	0.00	3,703,631.00	5,634,421.63	61.30%
	2	2019/06/11-2019/06/30	1,878,908.13	0.00	0.00	1,878,908.13	20.44%
产品特有风险							
报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。

新沃基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日