

# 新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 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：二〇二〇年四月二十二日

## § 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 2020 年 4 月 17 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。

本报告中财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误！未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 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.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
8.6 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.....	52

8.7 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.....	52
8.8 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.....	52
8.9 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.....	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
8.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
9.3 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.....	54
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	56
11.2 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.....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
11.4 基金投资策略的改变.....	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
11.8 其他重大事件.....	58
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>
12.1 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.....	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>63</b>
13.1 备查文件目录.....	63
13.2 存放地点.....	63
13.3 查阅方式.....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金
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	2,675,499.00 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@sinovofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-698-9988	95588
传真		010-58290555	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区民生路 1299 号 1504 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市海淀区丹棱街 3 号 中国电子大厦 B 座 1616 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	100080	100140
法定代表人	朱灿	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.sinvofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	新沃基金管理有限公司	北京市海淀区丹棱街 3 号中国电子大厦 B 座 1616 室

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	2,226,206.98	-1,765,801.34	-28,427.82
本期利润	2,807,598.01	-2,046,978.41	-80,396.01
加权平均基金份额本期利润	0.2918	-0.1634	-0.0050
本期加权平均净值利润率	28.58%	-17.60%	-0.47%
本期基金份额净值增长率	31.91%	-15.15%	-2.20%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	132,049.64	-1,939,483.09	267,392.09
期末可供分配基金份额利润	0.0494	-0.1315	0.0235
期末基金资产净值	3,062,374.40	12,805,364.99	11,658,521.67
期末基金份额净值	1.145	0.868	1.023
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	54.50%	17.12%	38.03%

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

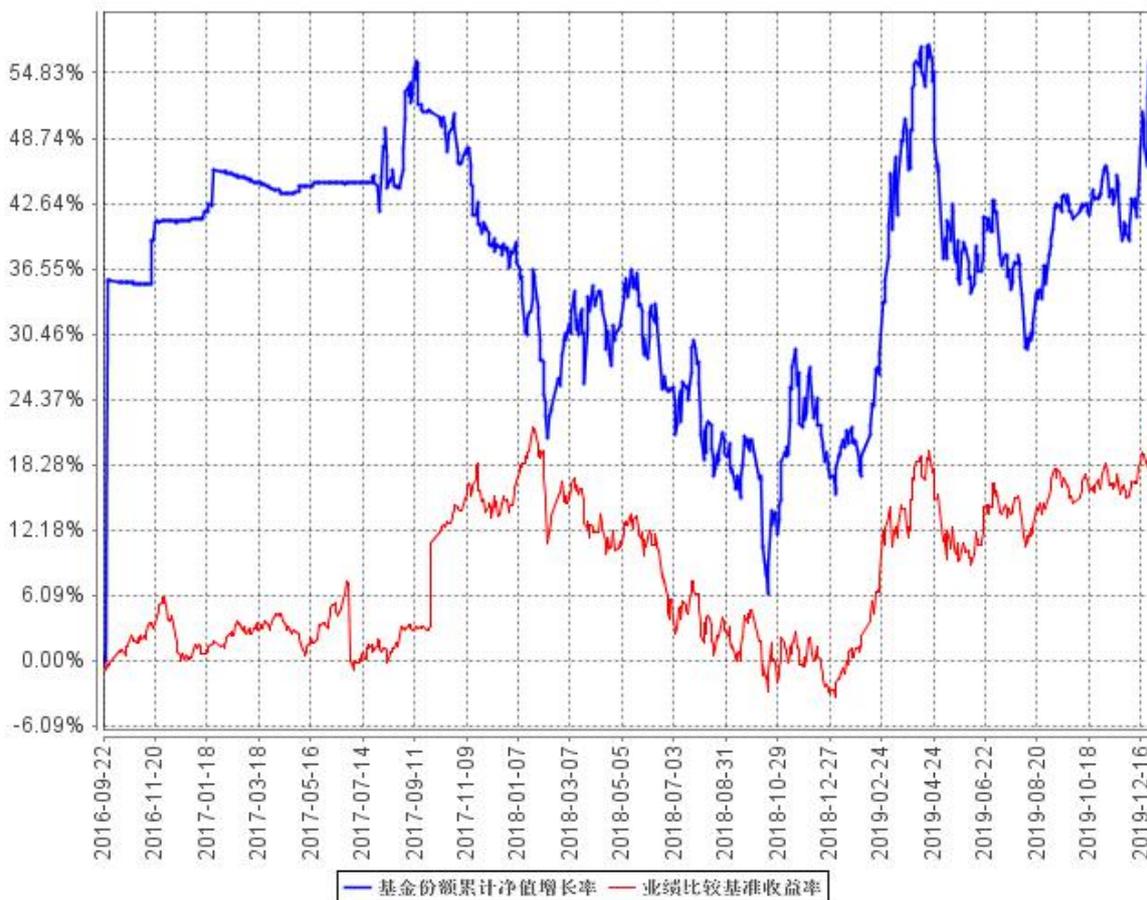
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	9.46%	1.04%	5.34%	0.49%	4.12%	0.55%
过去六个月	10.31%	0.97%	5.66%	0.57%	4.65%	0.40%
过去一年	31.91%	1.20%	24.11%	0.82%	7.80%	0.38%
过去三年	9.46%	1.07%	20.32%	0.83%	-10.86%	0.24%
自基金合同生效起至今	54.50%	1.62%	20.76%	0.80%	33.74%	0.82%

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。

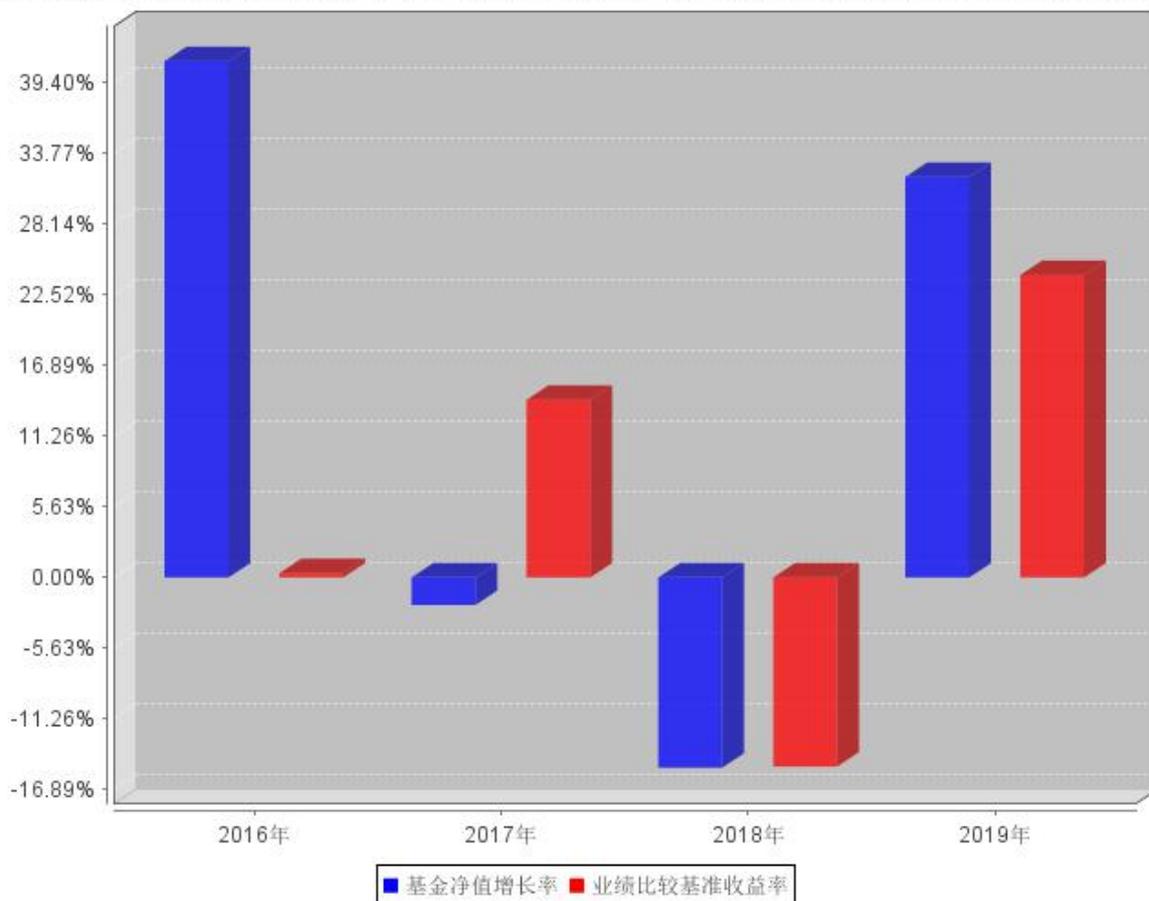
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2016 年 9 月 22 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过往三年未进行利润分配

## § 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，经营范围包括基金募集、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。截至 2019 年 12 月 31 日，公司共管理 3 只公募基金，分别是新沃通宝货币市场基金、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。

未来，公司将继续秉承“专业创造价值，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		
陈乐华	本基金的基金经理、投资研究部研究总监	2019 年 9 月 30 日	-	13 年	中央财经大学金融学硕士，中国籍。2007 年 7 月至 2010 年 5 月任职于中信建投证券，担任研究发展部经理；2010 年 5 月至 2016 年 10 月任职于华宝兴业基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理、高级分析师等职务；2016 年 11 月至 2018 年 8 月任职于北信瑞丰基金管理有限公司，担任基金经理；2018 年 9 月加入新沃基金管理有限公司，任投资研究部研究总监，现任新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
俞璿	本基金的基金经理	2018 年 6 月 28 日	-	7 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，现任新沃通宝货币市场基金基金经理、新沃通利纯债债券型证券投资基金基金经理、新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《新沃基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证对公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

## 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

2019年，中国经济增速整体呈现前高后低的特征，增速继续下台阶，由2018年的6.7%下降到6.1%。但在全球范围内而言，这依然是一个非常不错的增速，充分展现出了中国经济发展的强

劲韧性和巨大潜力。2019 年，中国人均 GDP 首次站上 1 万美元新台阶，标志着我国向高收入国家迈出了坚实的一步。2019 年 PPI 呈现前高后低的走势，但到年底有止跌企稳迹象。CPI 则由于受到猪肉价格暴涨影响而逐月走高，9 月份突破 3%，12 月份已经上升到 4.5%，这给货币政策的宽松造成一定的制约。另外，中美相互对对方进口的部分产品加征关税也一定程度上对经济增长带来了负面影响。

2019 年的股票市场却表现非常不错，各大主要指数均取得了不错的涨幅，其中：上证指数上涨 22.3%，沪深 300 指数上涨 36.07%，中小板指数上涨 41.03%，创业板指数上涨 43.79%。从中信一级行业指数来看，食品饮料、电子元器件和家电行业的涨幅超过 60%，而钢铁和建筑行业的涨幅则不到 3%。

报告期间，本基金在四季度以前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。进入四季度以后，我们采取自下而上的选股思路，重点投资和配置了新能源汽车、芯片半导体和其他科技股，并提高了股票仓位，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 1.145 元；本报告期基金份额净值增长率为 31.91%，业绩比较基准收益率为 24.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年，中国经济虽然面临各种困难，但依然实现了不错的增速。展望 2020 年，我们预计中国经济增速依然面临增速继续小幅下台阶的考验，但经济增速将有望呈现前低后高的，货币政策将维持较为宽松的局面，利率有望继续下降。另外，中美贸易争端的缓解也有望为中国经济营造一个较好的发展环境。

股票市场在经历了 2019 年的大幅上涨后，我们预计 2020 年更多的是结构性的机会。我们看好以芯片为首的半导体板块、新能源汽车产业链中的汽车零部件以及锂钴原材料板块和 5G 相关的基础建设以及游戏、传媒等下游应用板块的投资机会。另外，我们也十分看好基于自主可控的计算硬件及其软件板块的市场表现。

未来，我们将依然严格恪守投资边界，采取自下而上为主，自上而下为辅的选股策略，继续长期致力于投资于业绩快速增长且估值合理的公司。同时，在遵守本基金契约的前提下，本基金还将持续关注代表中国经济未来发展方向，未来发展前景较好的成长股以及传统行业中盈利有所改善或者未来通过改革能激发公司新的活力的优质公司。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作。基金管理人积极跟踪

法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，进一步完善公司的内部制度及流程，促进公司各项业务合法合规；组织了多项合规及业务培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设；针对销售、投资研究等重点业务，加大内部检查力度，确保基金运作的稳健合规；对基金的宣传推介、投资交易、运营、IT 等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，避免违规行为的发生。

本报告期内本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提升监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### **4.9 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 12 月 31 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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 22811 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了新沃通盈混合基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于新沃通盈混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	新沃通盈混合基金的基金管理人新沃基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估新沃通盈混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算新沃通盈混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督新沃通盈混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证

	<p>据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对新沃通盈混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致新沃通盈混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇 郭蕙心
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2020 年 4 月 21 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	7,903.06	48,359.34
结算备付金		18,313.76	255,747.21
存出保证金		8,303.88	16,383.24
交易性金融资产	7.4.7.2	2,889,016.00	12,534,045.00
其中：股票投资		2,889,016.00	11,801,547.00
基金投资		-	-
债券投资		-	732,498.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		203,731.99	235,800.05
应收利息	7.4.7.5	55.37	20,569.93
应收股利		-	-
应收申购款		6,090.85	4,680.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,133,414.91	13,115,585.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	194,681.82
应付赎回款		1,566.88	8,798.46
应付管理人报酬		1,574.72	6,726.62
应付托管费		393.68	1,681.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,505.23	31,829.79
应交税费		-	2.41
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	64,000.00	66,500.00
负债合计		71,040.51	310,220.75
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,675,499.00	14,744,848.08
未分配利润	7.4.7.10	386,875.40	-1,939,483.09
所有者权益合计		3,062,374.40	12,805,364.99
负债和所有者权益总计		3,133,414.91	13,115,585.74

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,675,499.00 份，基金份额净值 1.145 元。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		3,284,677.33	-1,474,602.81
1. 利息收入		29,265.99	48,189.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,106.53	10,721.62
债券利息收入		18,749.65	24,172.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,409.81	13,295.92
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,627,718.91	-1,244,886.08
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,496,194.67	-1,323,431.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-5,183.85	-7,404.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	136,708.09	85,949.14
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	581,391.03	-281,177.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	46,301.40	3,270.71
<b>减：二、费用</b>		477,079.32	572,375.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	59,318.70	69,666.95
2. 托管费	7.4.10.2.2	14,829.72	17,416.75
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	310,727.99	363,063.16

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.91	3.74
7. 其他费用	7.4.7.20	92,200.00	122,225.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,807,598.01	-2,046,978.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,807,598.01	-2,046,978.41

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31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）	-	2,807,598.01	2,807,598.01
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）	-12,069,349.08	-481,239.52	-12,550,588.60
其中：1. 基金申购款	4,679,822.45	221,906.78	4,901,729.23
2. 基金赎回款	-16,749,171.53	-703,146.30	-17,452,317.83
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）	2,675,499.00	386,875.40	3,062,374.40
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31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	11,391,129.58	267,392.09	11,658,521.67

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,046,978.41	-2,046,978.41
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)	3,353,718.50	-159,896.77	3,193,821.73
其中:1.基金申购款	4,546,751.58	-262,869.10	4,283,882.48
2.基金赎回款	-1,193,033.08	102,972.33	-1,090,060.75
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)	14,744,848.08	-1,939,483.09	12,805,364.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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(以下简称“新沃基金”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

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。

本财务报表由本基金的基金管理人新沃基金于 2020 年 4 月 21 日批准报出。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2019 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债为其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经

营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 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。

#### **7.4.5.2 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。

#### **7.4.5.3 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。

### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局[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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	7,903.06	48,359.34
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：	7,903.06	48,359.34

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,640,770.23	2,889,016.00	248,245.77	
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	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,640,770.23	2,889,016.00	248,245.77	
项目	上年度末 2018年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	12,132,817.79	11,801,547.00	-331,270.79	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	734,372.47	732,498.00	-1,874.47
	银行间市场	-	-	-
	合计	734,372.47	732,498.00	-1,874.47
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	12,867,190.26	12,534,045.00	-333,145.26
----	---------------	---------------	-------------

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	42.17	14.99
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	9.13	126.61
应收债券利息	-	20,420.19
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	4.07	8.14
合计	55.37	20,569.93

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上期末未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,505.23	31,829.79
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,505.23	31,829.79

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	64,000.00	66,500.00
合计	64,000.00	66,500.00

**7.4.7.9 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12月31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	4,679,822.45	4,679,822.45
本期赎回（以“-”号填列）	-16,749,171.53	-16,749,171.53
本期末	2,675,499.00	2,675,499.00

**7.4.7.10 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	2,226,206.98	581,391.03	2,807,598.01
本期基金份额交易产生的变动数	-370,394.20	-110,845.32	-481,239.52
其中：基金申购款	69,465.85	152,440.93	221,906.78
基金赎回款	-439,860.05	-263,286.25	-703,146.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,049.64	254,825.76	386,875.40

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月	2018年1月1日至2018年12月31

	31 日	日
活期存款利息收入	3,741.36	7,711.33
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	3,134.30	2,613.88
其他	230.87	396.41
合计	7,106.53	10,721.62

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年12月31日
卖出股票成交总额	200,236,841.17	187,412,226.51
减：卖出股票成本总额	197,740,646.50	188,735,657.73
买卖股票差价收入	2,496,194.67	-1,323,431.22

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31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	-5,183.85	-7,404.00
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	-5,183.85	-7,404.00

##### 7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,581,799.55	1,125,331.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,541,840.77	1,103,904.00
减：应收利息总额	45,142.63	28,831.50
买卖债券差价收入	-5,183.85	-7,404.00

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	136,708.09	85,949.14
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	136,708.09	85,949.14

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	581,391.03	-281,177.07
——股票投资	579,516.56	-315,239.07
——债券投资	1,874.47	34,062.00
——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	581,391.03	-281,177.07

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
基金赎回费收入	46,301.40	3,270.71
合计	46,301.40	3,270.71

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。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	310,727.99	363,063.16
银行间市场交易费用	-	-
合计	310,727.99	363,063.16

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	-	30,000.00
其他手续费	1,200.00	1,225.00
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
律师费用	-	-
开户费	-	-
合计	92,200.00	122,225.00

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	59,318.70	69,666.95
其中：支付销售机构的客户维护费	3,744.59	821.28

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 X 0.60% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,829.72	17,416.75

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 X 0.15% / 当年天数。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

本基金本报告期内及上年度可比期间无销售服务费。

**7.4.10.3 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。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31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	70.23%	12.74%

**7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 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	
	2019年1月1日至2019年12月31日		2018年1月1日至2018年12月31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	7,903.06	3,741.36	48,359.34	7,711.33

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。

**7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

##### 7.4.12.2 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
603799	华友钴业	2019年12月31日	因重大资产重组停牌	39.39	2020年1月2日	40.43	5,000	144,346.56	196,950.00	-

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 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。

###### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会为核心

的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2018 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.23%）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 6.4313%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	7,903.06	-	-	-	7,903.06
结算备付金	18,313.76	-	-	-	18,313.76
存出保证金	8,303.88	-	-	-	8,303.88
交易性金融资产	-	-	-	2,889,016.00	2,889,016.00
应收证券清算款	-	-	-	203,731.99	203,731.99
应收利息	-	-	-	55.37	55.37
应收申购款	-	-	-	6,090.85	6,090.85
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	34,520.70	-	-	3,098,894.21	3,133,414.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,566.88	1,566.88
应付管理人报酬	-	-	-	1,574.72	1,574.72
应付托管费	-	-	-	393.68	393.68
应付交易费用	-	-	-	3,505.23	3,505.23

应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	64,000.00	64,000.00
负债总计	-	-	-	71,040.51	71,040.51
利率敏感度缺口	34,520.70	-	-	3,027,853.70	3,062,374.40
上年度末 2018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	48,359.34	-	-	-	48,359.34
结算备付金	255,747.21	-	-	-	255,747.21
存出保证金	16,383.24	-	-	-	16,383.24
交易性金融资产	703,080.00	29,418.00	-	-11,801,547.00	12,534,045.00
应收证券清算款	-	-	-	235,800.05	235,800.05
应收利息	-	-	-	20,569.93	20,569.93
应收申购款	-	-	-	4,680.97	4,680.97
资产总计	1,023,569.79	29,418.00	-	-12,062,597.95	13,115,585.74
负债					
应付证券清算款	-	-	-	194,681.82	194,681.82
应付赎回款	-	-	-	8,798.46	8,798.46
应付管理人报酬	-	-	-	6,726.62	6,726.62
应付托管费	-	-	-	1,681.65	1,681.65
应付交易费用	-	-	-	31,829.79	31,829.79
应交税费	-	-	-	2.41	2.41
其他负债	-	-	-	66,500.00	66,500.00
负债总计	-	-	-	310,220.75	310,220.75
利率敏感度缺口	1,023,569.79	29,418.00	-	-11,752,377.20	12,805,364.99

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2018年12月31日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为5.72%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018年12月31日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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相互结合的选股方法，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资比例不超过基金资产净值的 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的 5%。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	2,889,016.00	94.34	11,801,547.00	92.16
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	732,498.00	5.72
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	2,889,016.00	94.34	12,534,045.00	97.88

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	185,737.26	574,013.12
	沪深 300 指数下降 5%	-185,737.26	-574,013.12

#### 7.4.14 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 12 月 31 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资产中属于第一层次的余额为 2,692,066.00 元，属于第二层次的余额为 196,950.00 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 11,568,839.00 元，属于第二层次的余额为 965,206.00 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 12 月 31 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	2,889,016.00	92.20
	其中：股票	2,889,016.00	92.20
2	基金投资	-	-
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	26,216.82	0.84
8	其他各项资产	218,182.09	6.96
9	合计	3,133,414.91	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,339,434.00	76.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	406,467.00	13.27
J	金融业	143,115.00	4.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,889,016.00	94.34

### 8.2.2 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。

### 8.3 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	300750	宁德时代	2,300	244,720.00	7.99
2	002460	赣锋锂业	6,600	229,878.00	7.51
3	603799	华友钴业	5,000	196,950.00	6.43
4	002850	科达利	3,300	150,150.00	4.90
5	002624	完美世界	3,400	150,076.00	4.90
6	300035	中科电气	18,600	146,382.00	4.78
7	000001	平安银行	8,700	143,115.00	4.67
8	002920	德赛西威	4,600	139,518.00	4.56
9	300604	长川科技	5,700	135,774.00	4.43
10	300034	钢研高纳	8,500	135,745.00	4.43
11	002555	三七互娱	4,900	131,957.00	4.31
12	300223	北京君正	1,500	130,725.00	4.27
13	600584	长电科技	5,800	127,484.00	4.16
14	300383	光环新网	6,200	124,434.00	4.06
15	002036	联创电子	7,200	122,472.00	4.00
16	000977	浪潮信息	4,000	120,400.00	3.93
17	603305	旭升股份	3,400	115,430.00	3.77
18	002602	世纪华通	9,000	102,870.00	3.36
19	603197	保隆科技	3,000	94,590.00	3.09
20	002161	远望谷	9,700	91,956.00	3.00
21	002497	雅化集团	7,000	54,390.00	1.78

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	2,605,499.00	20.35
2	002032	苏泊尔	853,005.00	6.66
3	600016	民生银行	729,006.80	5.69
4	002682	龙洲股份	611,309.08	4.77
5	601998	中信银行	590,391.00	4.61
6	600019	宝钢股份	583,428.00	4.56
7	601169	北京银行	575,692.80	4.50
8	600000	浦发银行	552,076.00	4.31
9	300673	佩蒂股份	545,266.00	4.26
10	601996	丰林集团	538,099.00	4.20
11	601229	上海银行	527,068.00	4.12
12	000898	鞍钢股份	517,894.00	4.04
13	601088	中国神华	517,038.00	4.04
14	600189	吉林森工	504,263.00	3.94
15	603589	口子窖	502,839.00	3.93
16	600127	金健米业	485,744.00	3.79
17	000809	铁岭新城	474,835.00	3.71
18	002286	保龄宝	467,335.00	3.65
19	000651	格力电器	464,385.00	3.63
20	600919	江苏银行	464,140.00	3.62
21	603868	飞科电器	440,788.78	3.44
22	603031	安德利	436,274.00	3.41
23	300733	西菱动力	434,574.00	3.39
24	002623	亚玛顿	434,319.00	3.39
25	600188	兖州煤业	432,824.00	3.38
26	600578	京能电力	420,708.00	3.29
27	300529	健帆生物	416,646.00	3.25
28	601988	中国银行	414,004.00	3.23
29	002275	桂林三金	412,121.00	3.22
30	601009	南京银行	410,069.00	3.20
31	000428	华天酒店	407,330.00	3.18

32	603725	天安新材	407,135.00	3.18
33	601166	兴业银行	402,628.00	3.14
34	000858	五粮液	397,061.00	3.10
35	603090	宏盛股份	395,145.00	3.09
36	601939	建设银行	391,101.48	3.05
37	600383	金地集团	389,869.00	3.04
38	600015	华夏银行	389,575.00	3.04
39	300442	普丽盛	387,202.00	3.02
40	600104	上汽集团	385,189.00	3.01
41	300150	世纪瑞尔	383,748.00	3.00
42	601328	交通银行	381,891.00	2.98
43	300235	方直科技	380,557.00	2.97
44	002220	ST 天宝	377,480.00	2.95
45	000026	飞亚达 A	369,333.00	2.88
46	600926	杭州银行	369,252.00	2.88
47	600436	片仔癀	363,364.00	2.84
48	000709	河钢股份	359,637.00	2.81
49	002415	海康威视	358,856.00	2.80
50	603139	康惠制药	354,587.00	2.77
51	600488	天药股份	352,978.00	2.76
52	000157	中联重科	350,971.00	2.74
53	601818	光大银行	350,861.00	2.74
54	600022	山东钢铁	350,101.00	2.73
55	002719	麦趣尔	349,278.00	2.73
56	603886	元祖股份	346,313.01	2.70
57	002916	深南电路	343,124.00	2.68
58	600376	首开股份	342,443.00	2.67
59	601898	中煤能源	339,616.00	2.65
60	600510	黑牡丹	334,513.00	2.61
61	600723	首商股份	331,000.00	2.58
62	601997	贵阳银行	329,810.00	2.58
63	002394	联发股份	326,743.00	2.55
64	601288	农业银行	324,929.00	2.54
65	300301	长方集团	323,767.00	2.53
66	603025	大豪科技	321,803.36	2.51
67	000402	金融街	317,589.00	2.48

68	000719	中原传媒	315,993.00	2.47
69	000833	粤桂股份	311,430.00	2.43
70	603986	兆易创新	311,345.00	2.43
71	601633	长城汽车	305,010.00	2.38
72	603799	华友钴业	303,392.56	2.37
73	002110	三钢闽光	302,107.00	2.36
74	600515	海航基础	300,876.00	2.35
75	000883	湖北能源	300,790.00	2.35
76	600808	马钢股份	299,224.00	2.34
77	002561	徐家汇	298,534.00	2.33
78	000663	永安林业	297,817.00	2.33
79	300426	唐德影视	296,228.00	2.31
80	600827	百联股份	295,851.00	2.31
81	300421	力星股份	291,927.00	2.28
82	002705	新宝股份	289,212.00	2.26
83	000619	海螺型材	288,124.00	2.25
84	000983	西山煤电	287,659.00	2.25
85	002327	富安娜	287,601.00	2.25
86	002624	完美世界	286,466.00	2.24
87	603355	莱克电气	286,400.00	2.24
88	600475	华光股份	286,309.16	2.24
89	603008	喜临门	285,721.00	2.23
90	603029	天鹅股份	285,335.00	2.23
91	300750	宁德时代	284,841.00	2.22
92	000799	酒鬼酒	281,410.00	2.20
93	603001	奥康国际	281,210.00	2.20
94	600023	浙能电力	280,592.00	2.19
95	603711	香飘飘	279,990.00	2.19
96	300669	沪宁股份	278,185.00	2.17
97	002724	海洋王	273,131.00	2.13
98	600795	国电电力	272,508.00	2.13
99	002824	和胜股份	271,187.00	2.12
100	300550	和仁科技	268,843.00	2.10
101	603685	晨丰科技	266,470.00	2.08
102	000978	桂林旅游	265,730.00	2.08
103	300656	民德电子	265,499.00	2.07

104	300716	国立科技	263,990.00	2.06
105	300631	久吾高科	263,193.00	2.06
106	002938	鹏鼎控股	262,478.00	2.05
107	000895	双汇发展	259,504.00	2.03
108	600650	锦江投资	259,024.00	2.02
109	300616	尚品宅配	258,242.00	2.02
110	600011	华能国际	258,084.00	2.02
111	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。

#### 8.4.2 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	2,721,856.00	21.26
2	002032	苏泊尔	939,122.00	7.33
3	600016	民生银行	772,860.00	6.04
4	002682	龙洲股份	646,766.00	5.05
5	601998	中信银行	642,635.00	5.02
6	600019	宝钢股份	627,993.00	4.90
7	601169	北京银行	620,263.12	4.84
8	000651	格力电器	587,361.00	4.59
9	601229	上海银行	579,047.20	4.52
10	601088	中国神华	570,651.00	4.46
11	600000	浦发银行	557,507.00	4.35
12	603868	飞科电器	554,661.92	4.33
13	000898	鞍钢股份	552,048.60	4.31
14	601996	丰林集团	546,571.00	4.27
15	603031	安德利	541,289.00	4.23
16	603589	口子窖	515,917.00	4.03
17	600189	吉林森工	514,938.00	4.02
18	600919	江苏银行	513,024.00	4.01
19	300673	佩蒂股份	512,416.00	4.00
20	600127	金健米业	507,379.00	3.96
21	000809	铁岭新城	499,581.23	3.90
22	300529	健帆生物	474,791.00	3.71
23	300733	西菱动力	470,334.00	3.67
24	600188	兖州煤业	465,655.00	3.64

25	601988	中国银行	465,483.00	3.64
26	300442	普丽盛	461,018.00	3.60
27	601166	兴业银行	459,677.00	3.59
28	601009	南京银行	458,404.00	3.58
29	600383	金地集团	456,528.00	3.57
30	002286	保龄宝	455,821.00	3.56
31	601939	建设银行	446,455.15	3.49
32	603090	宏盛股份	439,281.00	3.43
33	002415	海康威视	438,659.00	3.43
34	600104	上汽集团	436,321.00	3.41
35	002623	亚玛顿	428,366.00	3.35
36	601328	交通银行	427,422.00	3.34
37	600436	片仔癀	421,699.00	3.29
38	600578	京能电力	419,532.00	3.28
39	600926	杭州银行	417,190.00	3.26
40	002275	桂林三金	410,200.00	3.20
41	300235	方直科技	407,253.56	3.18
42	603725	天安新材	406,253.00	3.17
43	600510	黑牡丹	404,577.00	3.16
44	000709	河钢股份	404,097.00	3.16
45	000858	五粮液	401,043.00	3.13
46	601818	光大银行	399,780.00	3.12
47	000428	华天酒店	393,214.00	3.07
48	300150	世纪瑞尔	388,785.00	3.04
49	002220	ST 天宝	388,384.00	3.03
50	600376	首开股份	387,971.00	3.03
51	600015	华夏银行	387,105.00	3.02
52	601997	贵阳银行	379,727.00	2.97
53	603139	康惠制药	377,403.00	2.95
54	002394	联发股份	375,565.00	2.93
55	600488	天药股份	371,780.00	2.90
56	000026	飞亚达 A	363,674.00	2.84
57	002916	深南电路	361,711.00	2.82
58	000157	中联重科	354,654.00	2.77
59	002110	三钢闽光	351,616.00	2.75
60	600022	山东钢铁	346,476.00	2.71
61	300301	长方集团	345,647.00	2.70
62	000333	美的集团	344,827.00	2.69

63	002719	麦趣尔	340,418.00	2.66
64	000895	双汇发展	340,318.00	2.66
65	600808	马钢股份	336,128.00	2.62
66	601898	中煤能源	334,433.00	2.61
67	600340	华夏幸福	331,983.00	2.59
68	002705	新宝股份	331,500.00	2.59
69	603025	大豪科技	330,764.80	2.58
70	000799	酒鬼酒	329,575.00	2.57
71	600723	首商股份	329,034.00	2.57
72	603008	喜临门	325,838.00	2.54
73	000833	粤桂股份	324,948.00	2.54
74	300330	华虹计通	323,528.40	2.53
75	601288	农业银行	321,186.00	2.51
76	300421	力星股份	318,495.00	2.49
77	603886	元祖股份	314,454.00	2.46
78	000402	金融街	314,229.00	2.45
79	601828	美凯龙	311,316.00	2.43
80	002824	和胜股份	308,511.00	2.41
81	603986	兆易创新	307,363.00	2.40
82	600475	华光股份	307,155.96	2.40
83	002561	徐家汇	304,795.00	2.38
84	601633	长城汽车	304,170.00	2.38
85	000883	湖北能源	303,711.00	2.37
86	300426	唐德影视	298,359.00	2.33
87	000663	永安林业	297,656.00	2.32
88	600515	海航基础	297,637.00	2.32
89	000719	中原传媒	297,601.00	2.32
90	300656	民德电子	297,049.00	2.32
91	600398	海澜之家	294,202.00	2.30
92	600827	百联股份	293,624.00	2.29
93	300550	和仁科技	292,381.80	2.28
94	603355	莱克电气	292,188.00	2.28
95	002724	海洋王	291,650.00	2.28
96	603866	桃李面包	289,980.00	2.26
97	000581	威孚高科	289,327.00	2.26
98	000983	西山煤电	288,559.00	2.25
99	300669	沪宁股份	287,695.00	2.25
100	603029	天鹅股份	286,805.00	2.24

101	002729	好利来	285,697.00	2.23
102	603685	晨丰科技	284,192.00	2.22
103	000619	海螺型材	284,126.00	2.22
104	002327	富安娜	284,005.00	2.22
105	601838	成都银行	282,979.00	2.21
106	000069	华侨城 A	282,927.00	2.21
107	300566	激智科技	282,047.80	2.20
108	300347	泰格医药	278,585.00	2.18
109	600650	锦江投资	277,161.00	2.16
110	600023	浙能电力	276,573.00	2.16
111	600694	大商股份	276,322.00	2.16
112	603001	奥康国际	272,900.00	2.13
113	600350	山东高速	272,185.00	2.13
114	603955	大千生态	272,027.60	2.12
115	300631	久吾高科	271,795.28	2.12
116	300275	梅安森	271,473.00	2.12
117	600561	江西长运	269,285.00	2.10
118	002938	鹏鼎控股	267,672.00	2.09
119	300650	太龙照明	266,738.40	2.08
120	603288	海天味业	266,566.00	2.08
121	000978	桂林旅游	264,422.00	2.06
122	603887	城地股份	264,368.00	2.06
123	600795	国电电力	263,832.00	2.06
124	603536	惠发食品	263,493.00	2.06
125	300293	蓝英装备	262,360.00	2.05
126	300616	尚品宅配	261,712.00	2.04
127	300716	国立科技	259,513.60	2.03
128	002921	联诚精密	259,147.00	2.02
129	600739	辽宁成大	257,986.00	2.01
130	600566	济川药业	257,804.00	2.01
131	600123	兰花科创	257,434.00	2.01

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。

#### 8.4.3 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	188,248,598.94
卖出股票收入（成交）总额	200,236,841.17

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

考虑相关交易费用。

## 8.5 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。

## 8.6 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。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	8,303.88
2	应收证券清算款	203,731.99
3	应收股利	-
4	应收利息	55.37
5	应收申购款	6,090.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	218,182.09

**8.12.4 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。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603799	华友钴业	196,950.00	6.43	因重大资产重组停牌

**8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
429	6,236.59	1,878,908.13	70.23%	796,590.87	29.77%

### 9.2 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	16,250.56	0.6074%

### 9.3 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

**§ 10 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	4,679,822.45
减:本报告期期间基金总赎回份额	16,749,171.53
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	2,675,499.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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，丁平先生已离任本公司副总经理职务，具体信息请参见基金管理人于 2019 年 7 月 10 日披露的《新沃基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 55,000 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 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、基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
渤海证券		1,120,802,627.62	31.10%	25,523.64	33.58%	-

安信证券	2	100,149,206.36	25.78%	21,160.21	27.84%	-
财通证券	2	94,239,858.26	24.26%	10,489.00	13.80%	-
联讯证券	1	66,534,453.39	17.13%	15,389.08	20.24%	-
国金证券	2	5,109,472.00	1.32%	2,612.50	3.44%	-
中银国际证券	2	1,649,822.48	0.42%	843.67	1.11%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-

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（60%）+销售服务（40%）。

基础服务占60%权重，销售服务占40%权重，由研究员负责打分，最后结果汇总成《研究部卖方打分表》提交给研究部负责人。

基础服务包括：报告、电话沟通、路演、单独调研、联合调研、深度推荐公司、带上市公司上门反路演、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。

### 11.7.2 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
渤海证券	813,643.71	64.47%	19,100,000.00	97.45%	-	-
安信证券	-	-	100,000.00	0.51%	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

联讯证券	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-
中银国际证券	448,464.86	35.53%	400,000.00	2.04%	-
中泰证券	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-

## 11.8 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	新沃基金管理有限公司关于旗下基金 2018 年 12 月 31 日基金资产净值公告	指定报刊和/或管理人网站	2019 年 1 月 1 日
2	新沃基金管理有限公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2019 年 1 月 8 日
3	新沃基金管理有限公司关于增加北京展恒基金销售股份有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2019 年 1 月 18 日
4	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2019 年 1 月 22 日
5	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2019 年第 1 号)新沃基金管理有限公司关于增加众升财富(北京)基金销售有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2019 年 3 月 22 日
6	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告	指定报刊和/或管理人网站	2019 年 3 月 29 日
7	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	指定报刊和/或管理人网站	2019 年 3 月 29 日

8	新沃基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2019年3月29日
9	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2019年4月19日
10	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2019 年第 1 号)	指定报刊和/或管理人网站	2019年5月6日
11	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2019 年第 1 号)	指定报刊和/或管理人网站	2019年5月6日
12	新沃基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司定投最低申购限额的公告	指定报刊和/或管理人网站	2019年5月20日
13	新沃基金管理有限公司关于新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金可投资科创板股票的公告	指定报刊和/或管理人网站	2019年6月28日
14	新沃基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年 6 月 30 日基金资产净值公告	指定报刊和/或管理人网站	2019年7月1日
15	新沃基金管理有限公司关于增加深圳前海财厚基金销售有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2019年7月1日
16	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2019年7月19日
17	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告	指定报刊和/或管理人网站	2019年8月23日

18	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	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 8 月 23 日
19	新沃基金管理有限公司关于增加大连网金基金销售有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 9 月 10 日
20	新沃基金管理有限公司关于增加北京中天嘉华基金销售有限公司为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 9 月 12 日
21	新沃基金管理有限公司关于新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 9 月 30 日
22	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2019 年第 2 号）	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 10 月 10 日
23	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019 年第 2 号）	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 10 月 10 日
24	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 10 月 24 日
25	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2019 年第 3 号）	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 11 月 5 日
26	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019 年第 3 号）	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 11 月 5 日
27	新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 11 月 5 日
28	新沃基金管理有限公司关于旗下基金修改基金合同和托管协议的	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 11 月 5 日

	公告		
29	新沃通盈灵活配置混合型证券投资 基金托管协议	指定报刊和/或管理人 网站	2019 年 11 月 5 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2019/01/01-2019/09/22	9,338,052.63	0.00	9,338,052.63	0.00	0.00%
	2	2019/06/11-2019/12/31	1,878,908.13	0.00	0.00	1,878,908.13	70.23%
	3	2019/09/30-2019/10/08	0.00	1,598,327.21	1,598,327.21	0.00	0.00%

#### 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。

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集注册新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

### 13.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

新沃基金管理有限公司

2020年4月22日