

新华沪深 300 指数增强型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	12
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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注.....	17
7	投资组合报告.....	33
7.1	期末基金资产组合情况.....	33
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	40
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.....	40
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	40
7.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.10	投资组合报告附注.....	40

8	基金份额持有人信息.....	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	41
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.4	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.....	42
9	开放式基金份额变动.....	43
10	重大事件揭示.....	43
10.1	基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4	基金投资策略的改变.....	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8	其他重大事件.....	45
11	备查文件目录.....	46
11.1	备查文件目录.....	46
11.2	存放地点.....	46
11.3	查阅方式.....	46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	新华沪深 300 指数增强	
基金主代码	005248	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 12 月 18 日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	164,165,194.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华沪深 300 指数增强 A	新华沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005248	008184
报告期末下属分级基金的份额总额	73,093,939.27 份	91,071,255.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强基金，股票投资比例为基金资产的 80%以上，因此主要资产配置为股票资产，可少量投资于合同约定的其他资产类别。在保证股票投资比例符合合同要求的基础上，结合风险、流动性、基金申购赎回、分红等因素，对其他各类可投资资产类别的配置进行微调。本基金的股票投资策略以指数化被动投资策略为基础策略，结合量化的选股模型、风险控制模型、流动性控制模型而形成综合的量化指数增强策略体系。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	齐岩	李申

负责人	联系电话	010-68779688	021-60637102
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008198866	021-60637111
传真		010-68779528	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层, 北京市海 淀区西三环北路11号海通时代 商务中心C1座	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		400010	100033
法定代表人		翟晨曦	田国立

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 号办公楼 19 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）	
	新华沪深 300 指数增强 A	新华沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	12,630,556.10	14,657,061.64
本期利润	8,195,104.02	7,094,741.73
加权平均基金份额本期利润	0.1024	0.0779

本期加权平均净值利润率	7.12%	5.44%
本期基金份额净值增长率	6.58%	6.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	新华沪深 300 指数增强 A	新华沪深 300 指数增强 C
期末可供分配利润	35,775,333.02	43,954,106.48
期末可供分配基金份额利润	0.4894	0.4826
期末基金资产净值	108,869,272.29	135,025,362.09
期末基金份额净值	1.4894	1.4826
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	新华沪深 300 指数增强 A	新华沪深 300 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	48.94%	48.26%

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

新华沪深 300 指数增强 A

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	0.21%	0.72%	-1.91%	0.76%	2.12%	-0.04%
过去三个月	7.00%	0.85%	3.32%	0.93%	3.68%	-0.08%
过去六个月	6.58%	1.20%	0.29%	1.25%	6.29%	-0.05%
过去一年	43.35%	1.23%	24.19%	1.27%	19.16%	-0.04%
自基金合同生效起至今	48.94%	1.24%	27.85%	1.31%	21.09%	-0.07%

新华沪深 300 指数增强 C

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	0.19%	0.72%	-1.91%	0.76%	2.10%	-0.04%
过去三个月	6.92%	0.85%	3.32%	0.93%	3.60%	-0.08%
过去六个月	6.42%	1.20%	0.29%	1.25%	6.13%	-0.05%
过去一年	42.93%	1.23%	24.19%	1.27%	18.74%	-0.04%
自基金合同生效起至今	48.26%	1.24%	27.85%	1.31%	20.41%	-0.07%

注：1、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）

*5%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

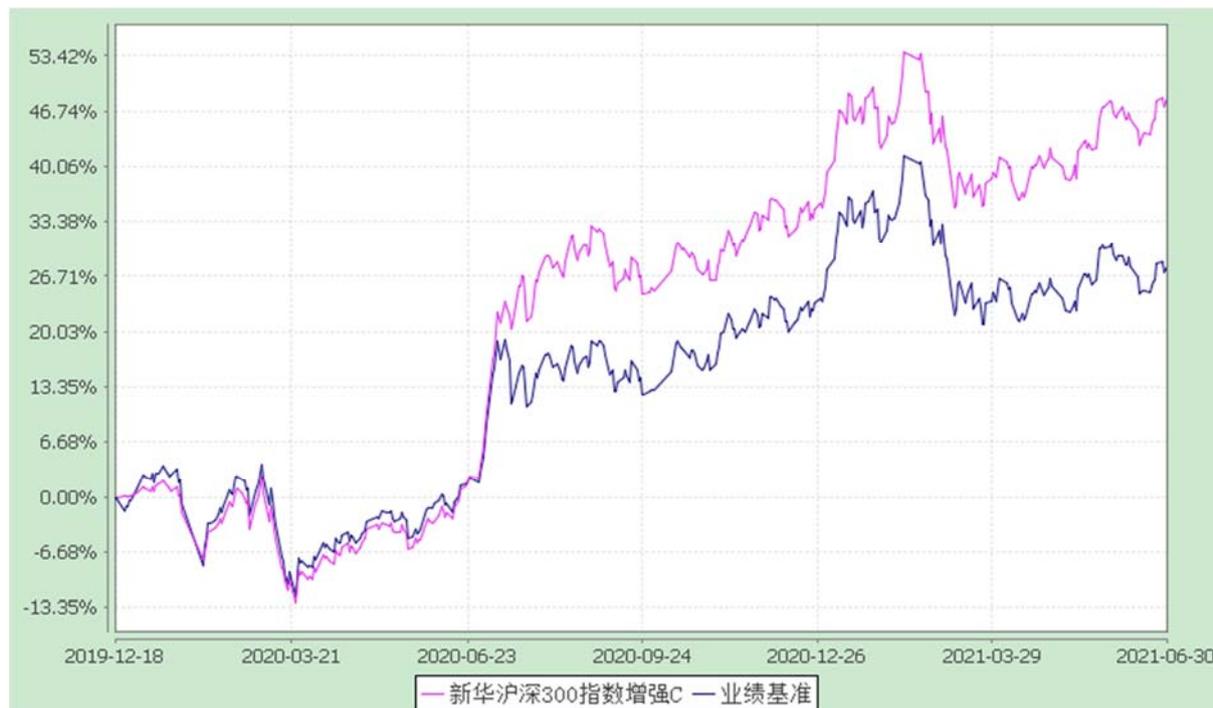
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华沪深 300 指数增强型证券投资基金
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
(2019 年 12 月 18 日至 2021 年 6 月 30 日)

新华沪深 300 指数增强 A



新华沪深 300 指数增强 C



注：报告期内本基金各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十二只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型

证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
邓岳	本基金基金经理，新华中证环保产业指数证券投资基金基金经理、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理。	2019-12-18	-	13	信息与信号处理专业硕士, 历任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员, 国信证券股份有限公司量化研究员, 光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理, 盈融达投资（北京）有限公司投资经理。

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

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》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沪深 300 指数增强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》、《新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，报告期内，未发生有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数增强基金，标的指数为沪深 300 指数，投资目标为在有效控制跟踪误差的基础上，争取获得超过标的指数的收益。

2021 年上半年，指数增强主要采用量化选股的投资策略，结合网下新股申购策略。其中量化选股策略主要基于多因子模型，综合采用估值、成长等多个大类的因子构建模型，整体模型符合 A 股市场的长期投资逻辑。。

2021 年上半年累计实现净值收益率 6.58%（A 类份额），同期沪深 300 指数收益率 0.24%，相对指数超额收益 6.34%，同期业绩比较基准收益 0.29%，相对业绩比较基准超额收益 6.29%；上半年年化跟踪误差 3.98%。报告期内获得了较好的超额收益，跟踪误差符合基金合同。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.4894 元，本报告期份额净值增长率为 6.58%，同期比较基准增长率为 0.29%；本基金 C 类份额净值为 1.4826 元，本报告期份额净值增长率为 6.42%，比较基准增长率为 0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来本基金将不断优化量化选股模型，结合网下新股申购策略，争取在维持与指数较小的跟踪误差的同时，获得超过指数的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.6.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

4.6.1.2 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

4.6.1.3 投资管理部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.6.1.4 交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

4.6.1.5 监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；

- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

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：新华沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,601,047.58	16,595,830.61
结算备付金		1,597,112.12	989,017.59
存出保证金		267,774.83	99,856.13
交易性金融资产	6.4.7.2	227,726,745.67	274,242,744.43
其中：股票投资		227,726,745.67	274,242,744.43
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		507,177.19	12,584,855.13
应收利息	6.4.7.5	1,856.85	2,100.55
应收股利		-	-
应收申购款		1,472,608.06	105,749.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		246,174,322.30	304,620,153.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		723,141.59	14,596,437.33
应付管理人报酬		189,204.19	255,847.89
应付托管费		28,380.63	38,377.21
应付销售服务费		29,947.58	42,643.70
应付交易费用	6.4.7.7	1,159,160.09	848,109.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	149,853.84	250,739.39
负债合计		2,279,687.92	16,032,155.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	164,165,194.88	206,855,738.31
未分配利润	6.4.7.10	79,729,439.50	81,732,260.44
所有者权益合计		243,894,634.38	288,587,998.75
负债和所有者权益总计		246,174,322.30	304,620,153.85

注：截至 2021 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.4894 元，基金份额 73,093,939.27 份，本基金 C 类份额净值为 1.4826 元，基金份额 91,071,255.61 份。

6.2 利润表

会计主体：新华沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		18,868,827.37	2,470,194.04
1.利息收入		34,150.40	431,537.16
其中：存款利息收入	6.4.7.11	34,150.40	388,048.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	43,489.01
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		30,690,382.09	-5,341,644.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	28,413,304.11	-7,953,766.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-44,760.00	-
股利收益	6.4.7.16	2,321,837.98	2,612,121.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-11,997,771.99	7,132,311.33
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	142,066.87	247,990.33
减：二、费用		3,578,981.62	4,824,452.89
1. 管理人报酬		1,223,662.09	1,542,150.43
2. 托管费		183,549.34	231,322.62

3. 销售服务费		195,409.31	317,112.31
4. 交易费用	6.4.7.19	1,771,202.56	2,521,962.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	205,158.32	211,905.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,289,845.75	-2,354,258.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,289,845.75	-2,354,258.85

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	206,855,738.31	81,732,260.44	288,587,998.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,289,845.75	15,289,845.75
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）	-42,690,543.43	-17,292,666.69	-59,983,210.12
其中：1.基金申购款	42,291,210.67	19,613,635.73	61,904,846.40
2.基金赎回款	-84,981,754.10	-36,906,302.42	-121,888,056.52
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）	164,165,194.88	79,729,439.50	243,894,634.38
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	490,309,695.94	3,065,001.43	493,374,697.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-2,354,258.85	-2,354,258.85

润)			
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)	-306,785,429.61	6,248,779.95	-300,536,649.66
其中: 1.基金申购款	27,950,798.99	-1,330,072.18	26,620,726.81
2.基金赎回款	-334,736,228.60	7,578,852.13	-327,157,376.47
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)	183,524,266.33	6,959,522.53	190,483,788.86

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

新华沪深 300 指数增强型证券投资基金(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[2017]1734 号文件准予注册，并经证监许可[2019]1817 号文件准予变更注册后，由新华基金管理股份有限公司发起募集的契约型开放式基金，于 2019 年 11 月 18 日至 2019 年 12 月 13 日向社会公开募集，首次募集资金总额 490,309,695.94 元，其中募集资金产生利息 48,337.68 元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2019]01360030 号验资报告予以验证。2019 年 12 月 18 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得相互转换。

根据《新华沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》及《新华沪深 300 指数增强型证券投资基金合同》，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成分股、备选成分股、其他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)、债券(国债、政府债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、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、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货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)。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。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:股票资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;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%的现金或者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、存出保证金及应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更基金投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金为指数增强基金,股票投资比例为基金资产的 80%以上,因此主要资产配置为股票资产,可少量投资于合同约定的其他资产类别。在保证股票投资比例符合合同要求的基础上,结合风险、流动性、基金申购赎回、分红等因素,对其他各类可投资资产类别的配置进行微调。本基金的股票投资策略以指数化被动投资策略为基础策略,结合量化的选股模型、风险控制模型、流动性控制模型而形成综合的量化指数增强策略体系。

本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%。本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2021 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础,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》、《新华沪深 300 指数增强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

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

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

本基金本报告期所采用的会计估计和会计政策与上年度一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	14,601,047.58
定期存款	-
其他存款	-
合计	14,601,047.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	220,351,124.77	227,726,745.67	7,375,620.90
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	220,351,124.77	227,726,745.67	7,375,620.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,499,460.00	-	-	-
——股指期货	1,499,460.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,499,460.00	-	-	-

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算保证金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵消后的净额为 0。

2、截至 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量	（买/卖）合约市值	公允价值变动
IF2109	IF2109	1	1,549,920.00	50,460.00
减：可抵消期货暂收款		50,460.00		
股指期货投资净额		0.00		

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,306.05
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	550.80
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,856.85

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,159,160.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,159,160.09

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	674.89
应付证券出借违约金	-
预提费用	99,178.95
应付指数使用费	50,000.00
合计	149,853.84

6.4.7.9 实收基金**新华沪深 300 指数增强 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,280,090.16	98,280,090.16
本期申购	7,371,870.39	7,371,870.39
本期赎回（以“-”号填列）	-32,558,021.28	-32,558,021.28
本期末	73,093,939.27	73,093,939.27

新华沪深 300 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	108,575,648.15	108,575,648.15
本期申购	34,919,340.28	34,919,340.28
本期赎回（以“-”号填列）	-52,423,732.82	-52,423,732.82
本期末	91,071,255.61	91,071,255.61

6.4.7.10 未分配利润**新华沪深 300 指数增强 A**

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	34,447,261.73	4,608,207.92	39,055,469.65
本期利润	12,630,556.10	-4,435,452.08	8,195,104.02
本期基金份额交易产生的变动数	-10,248,696.03	-1,226,544.62	-11,475,240.65
其中：基金申购款	3,115,032.36	160,578.84	3,275,611.20
基金赎回款	-13,363,728.39	-1,387,123.46	-14,750,851.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,829,121.80	-1,053,788.78	35,775,333.02

新华沪深 300 指数增强 C

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	37,600,941.46	5,075,849.33	42,676,790.79
本期利润	14,657,061.64	-7,562,319.91	7,094,741.73
本期基金份额交易产生的变动数	-6,997,492.69	1,180,066.65	-5,817,426.04
其中：基金申购款	15,449,604.25	888,420.28	16,338,024.53
基金赎回款	-22,447,096.94	291,646.37	-22,155,450.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,260,510.41	-1,306,403.93	43,954,106.48

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	25,464.18
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	8,686.22
其他	-
合计	34,150.40

注：结算备付金利息收入中包含结算保证金利息收入。

6.4.7.12 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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	668,329,384.95
减：卖出股票成本总额	639,916,080.84
买卖股票差价收入	28,413,304.11

6.4.7.12.2 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无股票投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

本报告期本基金未持有债券，无债券投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.14.1 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.2 债券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期本基金未持有贵金属，无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	-44,760.00

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,321,837.98
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	2,321,837.98

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-12,048,231.99
——股票投资	-12,048,231.99
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	50,460.00
——权证投资	-
——股指期货投资	50,460.00
4.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	-11,997,771.99

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	142,066.87
合计	142,066.87

注：基金赎回费收入中包括转出费收入。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,768,454.86
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	2,747.70
合计	1,771,202.56

6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

本报告期本基金未持有基金，无持有基金产生的费用。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券账户维护费	360.00
汇划手续费	5,619.37
指数使用费	100,000.00
合计	205,158.32

注：指数使用费为支付标的指数供应商中证指数有限公司的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，且收取下限为每季度人民币 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	89,523,481.44	7.06%	286,122,165.79	15.89%

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	65,468.43	6.74%	94,084.00	8.12%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	209,238.62	14.56%	274,384.59	32.80%

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,223,662.09	1,542,150.43
其中：支付销售机构的客户维护费	193,452.58	944,966.54

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1% 的年费率每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	183,549.34	231,322.62

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华沪深 300 指数增强 A	新华沪深 300 指数增强 C	合计
恒泰证券股份有限公司	-	51,818.74	51,818.74
新华基金管理股份有限公司	-	121,252.57	121,252.57
合计	-	173,071.31	173,071.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华沪深300指数增强A	新华沪深300指数增强C	合计
新华基金管理股份有限公司	-	14,433.85	14,433.85
恒泰证券股份有限公司	-	301,329.76	301,329.76

合计	-	315,763.61	315,763.61
----	---	------------	------------

注：基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.30%/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

本报告期本基金无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

本报告期本基金无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本报告期本基金无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 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

本报告期内，基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

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

本报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	14,601,047.58	25,464.18	19,499,934.32	98,471.31

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金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

本报告期本基金无其他关联交易事项的说明。

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

本报告期本基金未交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金无利润分配事项。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688690	纳微科技	2021-06-16	2021-12-23	新股锁定期内	8.07	79.89	3,477.00	28,059.39	277,777.53	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股锁定期内	10.19	18.40	10,511.00	107,107.09	193,402.40	-
688314	康拓医疗	2021-05-11	2021-11-18	新股锁定期内	17.34	74.48	1,085.00	18,813.90	80,810.80	-
688662	富信科技	2021-03-25	2021-10-08	新股锁定期内	15.61	29.51	2,556.00	39,899.16	75,427.56	-
688113	联测科技	2021-04-26	2021-11-08	新股锁定期内	19.14	49.29	1,415.00	27,083.10	69,745.35	-
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	新股锁定期内	14.48	19.21	3,279.00	47,479.92	62,989.59	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定期内	24.60	163.00	378.00	9,298.80	61,614.00	-
688359	三孚新科	2021-05-14	2021-11-22	新股锁定期内	11.03	26.35	2,213.00	24,409.39	58,312.55	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	网下中签	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定期内	47.33	251.96	213.00	10,081.29	53,667.48	-
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定	13.60	19.87	2,693.00	36,624.80	53,509.91	-

				期内						
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定期内	28.28	115.71	222.00	6,278.16	25,687.62	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定期内	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股锁定期内	12.54	27.89	713.00	8,941.02	19,885.57	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定期内	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2022-01-07	新股锁定期内	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定期内	48.59	90.39	189.00	9,183.51	17,083.71	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定期内	24.69	31.71	492.00	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定期内	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定期内	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定期内	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新股锁定期内	8.72	27.11	471.00	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定期内	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定期内	6.87	12.07	1,033.00	7,096.71	12,468.31	-

300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定期内	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定期内	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股锁定期内	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股锁定期内	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定期内	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定期内	12.85	25.80	371.00	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定期内	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定期内	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定期内	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股锁定期内	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定期内	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股锁定期内	8.67	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定期内	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股锁定期内	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-

300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定期内	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	网下中签	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股锁定期内	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定期内	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股锁定期内	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定期内	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定期内	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定期内	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股锁定期内	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-11-27	新股锁定期内	7.81	21.94	312.00	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定期内	13.06	26.51	254.00	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定期内	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定期内	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-11-17	新股锁定期内	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定期内	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-

300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定期内	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股锁定期内	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	新股锁定期内	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股锁定期内	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定期内	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股锁定期内	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定期内	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股锁定期内	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定期内	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定期内	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

6.4.12.2 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
600460	士兰微	2021-06-30	中国证监会并购重组审核委员会审核公司发行股份购买	56.35	2021-07-01	59.49	37,200.00	1,388,980.94	2,096,220.00	-

			资产并募集配套资金暨关联交易事项。							
688368	晶丰明源	2021-06-21	筹划发行股份及支付现金方式购买股权，同时拟向特定投资者非公开发行股份募集配套资金。	335.26	2021-07-05	402.31	2,000.00	715,110.00	670,520.00	-

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

截至报告期期末本基金无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期期末本基金无交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至报告期期末本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券。

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列示的资产支持证券。

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列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的债券。

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券。

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。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行

管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,601,047.58	-	-	-	14,601,047.58
结算备付金	1,597,112.12	-	-	-	1,597,112.12
存出保证金	267,774.83	-	-	-	267,774.83
交易性金融资产	-	-	-	227,726,745.67	227,726,745.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	507,177.19	507,177.19
应收利息	-	-	-	1,856.85	1,856.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,472,608.06	1,472,608.06
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,465,934.53	-	-	229,708,387.77	246,174,322.30
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	723,141.59	723,141.59
应付管理人报酬	-	-	-	189,204.19	189,204.19
应付托管费	-	-	-	28,380.63	28,380.63
应付销售服务费	-	-	-	29,947.58	29,947.58
应付交易费用	-	-	-	1,159,160.09	1,159,160.09
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	149,853.84	149,853.84
负债总计	-	-	-	2,279,687.92	2,279,687.92
利率敏感度缺口	16,465,934.53	-	-	227,428,699.85	243,894,634.38
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,595,830.61	-	-	-	16,595,830.61
结算备付金	989,017.59	-	-	-	989,017.59
存出保证金	99,856.13	-	-	-	99,856.13
交易性金融资产	-	-	-	274,242,744.43	274,242,744.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	12,584,855.13	12,584,855.13
应收利息	-	-	-	2,100.55	2,100.55
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	105,749.41	105,749.41
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,684,704.33	-	-	286,935,449.52	304,620,153.85
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-

衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	14,596,437.33	14,596,437.33
应付管理人报酬	-	-	-	255,847.89	255,847.89
应付托管费	-	-	-	38,377.21	38,377.21
应付销售服务费	-	-	-	42,643.70	42,643.70
应付交易费用	-	-	-	848,109.58	848,109.58
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	250,739.39	250,739.39
负债总计	-	-	-	16,032,155.10	16,032,155.10
利率敏感度缺口	17,684,704.33	-	-	270,903,294.42	288,587,998.75

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金无债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日

	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	227,726,745.67	93.37	274,242,744.43	95.03
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	227,726,745.67	93.37	274,242,744.43	95.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升或下降 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	2,135,050.14	2,810,695.06
	沪深 300 指数下降 1%	-2,135,050.14	-2,810,695.06

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	227,726,745.67	92.51
	其中: 股票	227,726,745.67	92.51
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	16,198,159.70	6.58
8	其他各项资产	2,249,416.93	0.91
9	合计	246,174,322.30	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

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,093,078.00	0.86
B	采矿业	2,334,213.00	0.96
C	制造业	95,866,781.74	39.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,250,031.00	1.33
E	建筑业	2,981,350.00	1.22
F	批发和零售业	58,992.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	5,576,094.80	2.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,014,969.70	1.65
J	金融业	54,736,529.84	22.44
K	房地产业	3,458,547.00	1.42
L	租赁和商务服务业	4,425,210.00	1.81
M	科学研究和技术服务业	5,276,311.00	2.16
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	20,890.00	0.01
Q	卫生和社会工作	2,078,467.40	0.85
R	文化、体育和娱乐业	1,447,755.00	0.59
S	综合	-	-
	合计	187,619,220.48	76.93

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	1,131,480.00	0.46
C	制造业	27,078,205.52	11.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	846,801.39	0.35
E	建筑业	687,106.37	0.28
F	批发和零售业	1,739,313.58	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	1,909,320.00	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,648,312.64	0.68
J	金融业	1,792,199.10	0.73
K	房地产业	1,385,570.00	0.57
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	279,156.31	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	455,770.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,143,000.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	40,107,525.19	16.44

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	5,800	11,928,860.00	4.89
2	601166	兴业银行	391,277	8,040,742.35	3.30
3	601628	中国人寿	216,300	7,330,407.00	3.01
4	601377	兴业证券	642,600	6,207,516.00	2.55
5	601077	渝农商行	1,529,900	6,104,301.00	2.50
6	600036	招商银行	106,235	5,756,874.65	2.36
7	000725	京东方 A	855,900	5,340,816.00	2.19
8	300676	华大基因	43,300	5,135,380.00	2.11
9	601919	中远海控	163,900	5,005,506.00	2.05
10	000100	TCL 科技	582,500	4,456,125.00	1.83
11	000333	美的集团	56,186	4,009,994.82	1.64
12	600809	山西汾酒	8,800	3,942,400.00	1.62
13	600309	万华化学	34,200	3,721,644.00	1.53
14	601888	中国中免	12,300	3,691,230.00	1.51
15	600887	伊利股份	93,200	3,432,556.00	1.41
16	600031	三一重工	117,500	3,415,725.00	1.40
17	300122	智飞生物	18,100	3,379,813.00	1.39
18	600111	北方稀土	156,200	3,233,340.00	1.33
19	601012	隆基股份	33,460	2,972,586.40	1.22
20	600845	宝信软件	54,999	2,799,449.10	1.15
21	603369	今世缘	51,200	2,772,992.00	1.14
22	601318	中国平安	42,513	2,732,735.64	1.12
23	002032	苏泊尔	42,294	2,697,934.26	1.11
24	601668	中国建筑	517,200	2,404,980.00	0.99
25	002179	中航光电	29,100	2,299,482.00	0.94
26	603806	福斯特	20,840	2,190,909.20	0.90
27	600837	海通证券	179,800	2,067,700.00	0.85
28	002714	牧原股份	33,800	2,055,716.00	0.84
29	600606	绿地控股	374,200	2,039,390.00	0.84
30	000858	五粮液	6,700	1,995,863.00	0.82
31	000338	潍柴动力	111,000	1,983,570.00	0.81
32	601211	国泰君安	114,100	1,955,674.00	0.80
33	688036	传音控股	8,932	1,871,254.00	0.77
34	601398	工商银行	350,300	1,811,051.00	0.74
35	002311	海大集团	21,600	1,762,560.00	0.72
36	601838	成都银行	125,200	1,582,528.00	0.65
37	300059	东方财富	47,080	1,543,753.20	0.63
38	002129	中环股份	39,900	1,540,140.00	0.63
39	600132	重庆啤酒	7,400	1,464,830.00	0.60
40	600795	国电电力	599,200	1,456,056.00	0.60
41	600763	通策医疗	3,400	1,397,400.00	0.57
42	601633	长城汽车	30,000	1,307,700.00	0.54
43	300003	乐普医疗	39,100	1,255,892.00	0.51
44	600919	江苏银行	175,820	1,248,322.00	0.51

45	600690	海尔智家	48,100	1,246,271.00	0.51
46	002739	万达电影	76,500	1,207,935.00	0.50
47	601857	中国石油	224,600	1,188,134.00	0.49
48	601238	广汽集团	87,100	1,127,945.00	0.46
49	601169	北京银行	229,500	1,117,665.00	0.46
50	603392	万泰生物	4,160	1,078,188.80	0.44
51	600176	中国巨石	66,149	1,025,970.99	0.42
52	600196	复星医药	14,100	1,017,033.00	0.42
53	600522	中天科技	97,700	977,000.00	0.40
54	002230	科大讯飞	14,400	973,152.00	0.40
55	601108	财通证券	91,000	954,590.00	0.39
56	601155	新城控股	22,500	936,000.00	0.38
57	600104	上汽集团	41,900	920,543.00	0.38
58	300124	汇川技术	11,900	883,694.00	0.36
59	601899	紫金矿业	91,000	881,790.00	0.36
60	000001	平安银行	38,700	875,394.00	0.36
61	600030	中信证券	34,000	847,960.00	0.35
62	603288	海天味业	6,206	800,263.70	0.33
63	600019	宝钢股份	103,100	787,684.00	0.32
64	000166	申万宏源	162,800	761,904.00	0.31
65	000776	广发证券	48,600	735,804.00	0.30
66	002027	分众传媒	78,000	733,980.00	0.30
67	002475	立讯精密	15,800	726,800.00	0.30
68	000425	徐工机械	109,900	700,063.00	0.29
69	600276	恒瑞医药	10,212	694,109.64	0.28
70	600958	东方证券	68,700	686,313.00	0.28
71	603501	韦尔股份	2,100	676,200.00	0.28
72	601336	新华保险	14,200	651,922.00	0.27
73	002008	大族激光	16,000	646,240.00	0.26
74	600436	片仔癀	1,400	627,620.00	0.26
75	600183	生益科技	26,400	618,024.00	0.25
76	600025	华能水电	99,200	574,368.00	0.24
77	603195	公牛集团	2,700	545,400.00	0.22
78	603882	金域医学	3,300	527,241.00	0.22
79	600332	白云山	15,400	521,290.00	0.21
80	003816	中国广核	192,400	513,708.00	0.21
81	601390	中国中铁	97,800	512,472.00	0.21
82	600741	华域汽车	19,100	501,757.00	0.21
83	300014	亿纬锂能	4,600	478,078.00	0.20
84	601288	农业银行	156,500	474,195.00	0.19
85	000651	格力电器	8,200	427,220.00	0.18
86	600900	长江电力	19,800	408,672.00	0.17
87	600150	中国船舶	23,800	392,938.00	0.16
88	600438	通威股份	9,000	389,430.00	0.16

89	000063	中兴通讯	11,500	382,145.00	0.16
90	002415	海康威视	5,500	354,750.00	0.15
91	600018	上港集团	68,500	326,745.00	0.13
92	000977	浪潮信息	11,400	320,682.00	0.13
93	002050	三花智控	13,200	316,536.00	0.13
94	000157	中联重科	33,787	312,191.88	0.13
95	600048	保利地产	25,900	311,836.00	0.13
96	603833	欧派家居	2,000	283,920.00	0.12
97	600426	华鲁恒升	8,920	276,074.00	0.11
98	600011	华能国际	63,300	267,126.00	0.11
99	601988	中国银行	82,100	252,868.00	0.10
100	600346	恒力石化	9,500	249,280.00	0.10
101	300413	芒果超媒	3,300	226,380.00	0.09
102	002049	紫光国微	1,400	215,866.00	0.09
103	601100	恒立液压	1,900	163,248.00	0.07
104	002460	赣锋锂业	1,300	157,417.00	0.06
105	601088	中国神华	7,700	150,304.00	0.06
106	603259	药明康德	900	140,931.00	0.06
107	603659	璞泰来	1,000	136,600.00	0.06
108	600705	中航资本	26,800	103,716.00	0.04
109	600989	宝丰能源	7,500	102,600.00	0.04
110	002508	老板电器	2,200	102,300.00	0.04
111	300015	爱尔眼科	1,430	101,501.40	0.04
112	000002	万科A	4,100	97,621.00	0.04
113	601328	交通银行	16,800	82,320.00	0.03
114	002142	宁波银行	2,100	81,837.00	0.03
115	002594	比亚迪	300	75,300.00	0.03
116	600000	浦发银行	7,100	71,000.00	0.03
117	000568	泸州老窖	300	70,782.00	0.03
118	601816	京沪高铁	12,000	63,480.00	0.03
119	002352	顺丰控股	900	60,930.00	0.02
120	002241	歌尔股份	1,400	59,836.00	0.02
121	601601	中国太保	2,000	57,940.00	0.02
122	600585	海螺水泥	1,400	57,470.00	0.02
123	600016	民生银行	13,000	57,330.00	0.02
124	002271	东方雨虹	900	49,788.00	0.02
125	300142	沃森生物	800	49,360.00	0.02
126	601688	华泰证券	3,100	48,980.00	0.02
127	600050	中国联通	11,300	48,816.00	0.02
128	601229	上海银行	5,900	48,380.00	0.02
129	600703	三安光电	1,500	48,075.00	0.02
130	002812	恩捷股份	200	46,820.00	0.02
131	300274	阳光电源	400	46,024.00	0.02
132	601766	中国中车	7,400	44,992.00	0.02

133	600999	招商证券	2,200	41,844.00	0.02
134	002304	洋河股份	200	41,440.00	0.02
135	600660	福耀玻璃	700	39,095.00	0.02
136	000661	长春高新	100	38,700.00	0.02
137	300347	泰格医药	200	38,660.00	0.02
138	601818	光大银行	10,100	38,178.00	0.02
139	603986	兆易创新	200	37,580.00	0.02
140	300498	温氏股份	2,600	37,362.00	0.02
141	600406	国电南瑞	1,540	35,789.60	0.01
142	600028	中国石化	8,200	35,752.00	0.01
143	603799	华友钴业	300	34,260.00	0.01
144	000625	长安汽车	1,300	34,164.00	0.01
145	601658	邮储银行	6,600	33,132.00	0.01
146	601009	南京银行	2,900	30,508.00	0.01
147	600588	用友网络	900	29,934.00	0.01
148	002493	荣盛石化	1,700	29,359.00	0.01
149	600570	恒生电子	300	27,975.00	0.01
150	002371	北方华创	100	27,738.00	0.01
151	002410	广联达	400	27,280.00	0.01
152	601225	陕西煤业	2,300	27,255.00	0.01
153	600893	航发动力	500	26,595.00	0.01
154	600584	长电科技	700	26,376.00	0.01
155	002601	龙蟠佰利	700	24,206.00	0.01
156	300450	先导智能	400	24,056.00	0.01
157	600926	杭州银行	1,600	23,600.00	0.01
158	300433	蓝思科技	800	23,528.00	0.01
159	000538	云南白药	200	23,144.00	0.01
160	601006	大秦铁路	3,500	23,030.00	0.01
161	002001	新 和 成	800	22,944.00	0.01
162	600015	华夏银行	3,700	22,903.00	0.01
163	601989	中国重工	5,500	22,660.00	0.01
164	601901	方正证券	2,400	22,464.00	0.01
165	000895	双汇发展	700	22,260.00	0.01
166	603993	洛阳钼业	4,300	22,188.00	0.01
167	600010	包钢股份	14,000	21,700.00	0.01
168	600029	南方航空	3,600	21,672.00	0.01
169	300408	三环集团	500	21,210.00	0.01
170	002607	中公教育	1,000	20,890.00	0.01
171	300595	欧普康视	200	20,710.00	0.01
172	601600	中国铝业	3,900	20,670.00	0.01
173	600352	浙江龙盛	1,500	20,610.00	0.01
174	601186	中国铁建	2,700	20,061.00	0.01
175	601138	工业富联	1,600	19,856.00	0.01
176	601916	浙商银行	5,000	19,850.00	0.01

177	001979	招商蛇口	1,800	19,710.00	0.01
178	600745	闻泰科技	200	19,380.00	0.01
179	600009	上海机场	400	19,252.00	0.01
180	000876	新希望	1,300	19,071.00	0.01
181	002236	大华股份	900	18,990.00	0.01
182	600143	金发科技	900	18,774.00	0.01
183	000768	中航西飞	700	18,396.00	0.01
184	002007	华兰生物	500	18,340.00	0.01
185	002202	金风科技	1,500	18,240.00	0.01
186	601788	光大证券	1,000	17,890.00	0.01
187	000069	华侨城 A	2,400	17,856.00	0.01
188	600109	国金证券	1,400	17,766.00	0.01
189	000938	紫光股份	800	17,504.00	0.01
190	601669	中国电建	4,500	17,415.00	0.01
191	600547	山东黄金	900	17,298.00	0.01
192	002736	国信证券	1,600	17,200.00	0.01
193	002555	三七互娱	700	16,814.00	0.01
194	601877	正泰电器	500	16,690.00	0.01
195	000783	长江证券	2,200	16,104.00	0.01
196	000786	北新建材	400	15,700.00	0.01
197	601985	中国核电	3,100	15,686.00	0.01
198	601555	东吴证券	1,800	15,012.00	0.01
199	002252	上海莱士	2,000	14,980.00	0.01
200	300601	康泰生物	100	14,900.00	0.01
201	601607	上海医药	700	14,791.00	0.01
202	002600	领益智造	1,600	14,704.00	0.01
203	601360	三六零	1,200	14,652.00	0.01
204	002384	东山精密	700	14,588.00	0.01
205	600886	国投电力	1,500	14,415.00	0.01
206	002624	完美世界	600	14,346.00	0.01
207	000703	恒逸石化	1,200	14,340.00	0.01
208	000963	华东医药	300	13,803.00	0.01
209	600115	中国东航	2,700	13,716.00	0.01
210	002044	美年健康	1,500	13,665.00	0.01
211	601800	中国交建	2,100	13,608.00	0.01
212	000728	国元证券	1,700	13,549.00	0.01
213	002602	世纪华通	2,100	13,482.00	0.01
214	300144	宋城演艺	800	13,440.00	0.01
215	600383	金地集团	1,300	13,312.00	0.01
216	601727	上海电气	3,100	13,144.00	0.01
217	000066	中国长城	900	13,140.00	0.01
218	601618	中国中冶	4,300	12,814.00	0.01
219	600061	国投资本	1,500	12,735.00	0.01
220	601066	中信建投	400	12,572.00	0.01

221	601111	中国国航	1,600	12,448.00	0.01
222	002841	视源股份	100	12,429.00	0.01
223	300136	信维通信	400	12,352.00	0.01
224	601162	天风证券	2,500	12,150.00	0.00
225	600760	中航沈飞	200	12,060.00	0.00
226	600600	青岛啤酒	100	11,565.00	0.00
227	600362	江西铜业	500	11,190.00	0.00
228	603019	中科曙光	400	11,044.00	0.00
229	002414	高德红外	400	11,032.00	0.00
230	002463	沪电股份	700	10,829.00	0.00
231	300558	贝达药业	100	10,824.00	0.00
232	002456	欧菲光	1,200	10,656.00	0.00
233	601878	浙商证券	800	10,464.00	0.00
234	000656	金科股份	1,800	10,422.00	0.00
235	601933	永辉超市	2,200	10,406.00	0.00
236	601216	君正集团	2,000	10,180.00	0.00
237	002157	正邦科技	800	9,560.00	0.00
238	601990	南京证券	900	9,468.00	0.00
239	002558	巨人网络	700	9,310.00	0.00
240	600655	豫园股份	800	9,272.00	0.00
241	601998	中信银行	1,700	8,670.00	0.00
242	300529	健帆生物	100	8,636.00	0.00
243	600489	中金黄金	1,000	8,620.00	0.00
244	601872	招商轮船	1,840	8,500.80	0.00
245	603899	晨光文具	100	8,456.00	0.00
246	000860	顺鑫农业	200	8,436.00	0.00
247	603517	绝味食品	100	8,429.00	0.00
248	600872	中炬高新	200	8,404.00	0.00
249	300628	亿联网络	100	8,380.00	0.00
250	000708	中信特钢	400	8,336.00	0.00
251	601319	中国人保	1,400	8,302.00	0.00
252	600085	同仁堂	200	8,170.00	0.00
253	002120	韵达股份	600	8,118.00	0.00
254	688009	中国通号	1,345	7,653.05	0.00
255	601881	中国银河	700	7,546.00	0.00
256	002673	西部证券	900	7,425.00	0.00
257	002938	鹏鼎控股	200	7,176.00	0.00
258	600848	上海临港	400	7,160.00	0.00
259	600233	圆通速递	700	7,007.00	0.00
260	600161	天坛生物	200	6,850.00	0.00
261	600521	华海药业	300	6,264.00	0.00
262	601696	中银证券	300	6,177.00	0.00
263	601995	中金公司	100	6,150.00	0.00
264	603338	浙江鼎力	100	5,869.00	0.00

265	600118	中国卫星	200	5,852.00	0.00
266	601021	春秋航空	100	5,690.00	0.00
267	603939	益丰药房	100	5,609.00	0.00
268	600340	华夏幸福	1,000	5,240.00	0.00
269	603233	大参林	100	5,111.00	0.00
270	002939	长城证券	400	4,452.00	0.00
271	601236	红塔证券	300	4,068.00	0.00
272	600482	中国动力	200	3,484.00	0.00
273	601231	环旭电子	200	3,362.00	0.00
274	000800	一汽解放	300	3,246.00	0.00
275	600918	中泰证券	300	3,246.00	0.00
276	601808	中海油服	200	2,872.00	0.00
277	002153	石基信息	100	2,351.00	0.00
278	002773	康弘药业	100	2,313.00	0.00
279	601698	中国卫通	100	1,619.00	0.00
280	002945	华林证券	100	1,382.00	0.00
281	600299	安迪苏	100	1,196.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600779	水井坊	20,700.00	2,615,445.00	1.07
2	600460	士兰微	37,200.00	2,096,220.00	0.86
3	601997	贵阳银行	215,300.00	1,541,548.00	0.63
4	300463	迈克生物	29,400.00	1,237,446.00	0.51
5	002245	蔚蓝锂芯	59,400.00	1,170,180.00	0.48
6	000723	美锦能源	150,400.00	1,137,024.00	0.47
7	600702	舍得酒业	4,500.00	962,010.00	0.39
8	300653	正海生物	12,100.00	947,430.00	0.39
9	603466	风语筑	56,720.00	927,372.00	0.38
10	600498	烽火通信	47,700.00	888,651.00	0.36
11	600867	通化东宝	72,500.00	865,650.00	0.35
12	300207	欣旺达	25,800.00	840,048.00	0.34
13	000560	我爱我家	175,200.00	783,144.00	0.32
14	300458	全志科技	8,700.00	762,642.00	0.31
15	002382	蓝帆医疗	36,200.00	754,770.00	0.31
16	300573	兴齐眼药	5,100.00	719,253.00	0.29
17	688368	晶丰明源	2,000.00	670,520.00	0.27
18	000062	深圳华强	37,800.00	639,198.00	0.26
19	600483	福能股份	54,900.00	575,901.00	0.24
20	601865	福莱特	14,400.00	569,232.00	0.23
21	600707	彩虹股份	56,400.00	530,724.00	0.22

22	300146	汤臣倍健	15,000.00	493,500.00	0.20
23	603260	合盛硅业	6,400.00	492,224.00	0.20
24	002603	以岭药业	16,800.00	489,888.00	0.20
25	002287	奇正藏药	17,100.00	461,187.00	0.19
26	300244	迪安诊断	11,900.00	455,770.00	0.19
27	000012	南 玻 A	42,900.00	439,296.00	0.18
28	002030	达安基因	20,680.00	439,243.20	0.18
29	600006	东风汽车	60,000.00	438,000.00	0.18
30	603486	科沃斯	1,800.00	410,544.00	0.17
31	002648	卫星石化	10,420.00	408,359.80	0.17
32	601636	旗滨集团	22,000.00	408,320.00	0.17
33	601866	中远海发	105,800.00	396,750.00	0.16
34	002425	凯撒文化	47,000.00	393,390.00	0.16
35	600039	四川路桥	61,000.00	382,470.00	0.16
36	000581	威孚高科	17,900.00	372,857.00	0.15
37	600089	特变电工	28,200.00	362,370.00	0.15
38	601168	西部矿业	29,900.00	356,707.00	0.15
39	000807	云铝股份	29,800.00	354,620.00	0.15
40	600260	凯乐科技	38,900.00	345,432.00	0.14
41	002152	广电运通	26,500.00	345,295.00	0.14
42	601598	中国外运	67,800.00	342,390.00	0.14
43	300002	神州泰岳	70,500.00	341,925.00	0.14
44	600704	物产中大	43,200.00	339,984.00	0.14
45	600648	外高桥	22,100.00	326,638.00	0.13
46	000528	柳 工	38,463.00	315,396.60	0.13
47	601699	潞安环能	26,700.00	315,327.00	0.13
48	002920	德赛西威	2,800.00	308,224.00	0.13
49	600895	张江高科	16,600.00	303,282.00	0.12
50	300755	华致酒行	7,400.00	301,994.00	0.12
51	002285	世联行	48,800.00	299,144.00	0.12
52	000090	天健集团	50,500.00	279,265.00	0.11
53	688690	纳微科技	3,477.00	277,777.53	0.11
54	600295	鄂尔多斯	15,500.00	277,295.00	0.11
55	600338	西藏珠峰	18,800.00	266,396.00	0.11
56	002064	华峰化学	18,400.00	261,280.00	0.11
57	000830	鲁西化工	13,900.00	260,347.00	0.11
58	600642	申能股份	42,000.00	257,880.00	0.11
59	601233	桐昆股份	10,600.00	255,354.00	0.10
60	600038	中直股份	4,800.00	253,152.00	0.10
61	002266	浙富控股	49,700.00	248,003.00	0.10
62	002408	齐翔腾达	19,800.00	245,916.00	0.10
63	000519	中兵红箭	21,900.00	234,768.00	0.10
64	002092	中泰化学	22,800.00	234,156.00	0.10
65	600563	法拉电子	1,400.00	221,704.00	0.09

66	601928	凤凰传媒	30,200.00	215,628.00	0.09
67	603444	吉比特	400.00	212,000.00	0.09
68	002847	盐津铺子	2,000.00	199,440.00	0.08
69	688079	美迪凯	10,511.00	193,402.40	0.08
70	601898	中煤能源	27,000.00	193,050.00	0.08
71	603043	广州酒家	7,100.00	182,612.00	0.07
72	600808	马钢股份	36,200.00	155,298.00	0.06
73	000825	太钢不锈	20,200.00	151,298.00	0.06
74	603489	八方股份	600.00	141,828.00	0.06
75	603678	火炬电子	1,800.00	121,500.00	0.05
76	601003	柳钢股份	20,100.00	118,590.00	0.05
77	600390	五矿资本	19,500.00	116,610.00	0.05
78	600398	海澜之家	13,800.00	99,912.00	0.04
79	600901	江苏租赁	19,100.00	99,320.00	0.04
80	002701	奥瑞金	18,600.00	95,604.00	0.04
81	002078	太阳纸业	6,800.00	90,780.00	0.04
82	002293	罗莱生活	6,400.00	85,696.00	0.04
83	600729	重庆百货	3,100.00	85,095.00	0.03
84	688314	康拓医疗	1,085.00	80,810.80	0.03
85	000488	晨鸣纸业	9,500.00	77,330.00	0.03
86	688662	富信科技	2,556.00	75,427.56	0.03
87	688113	联测科技	1,415.00	69,745.35	0.03
88	688663	新风光	3,279.00	62,989.59	0.03
89	300919	中伟股份	378.00	61,614.00	0.03
90	688359	三孚新科	2,213.00	58,312.55	0.02
91	688087	英科再生	2,469.00	54,219.24	0.02
92	300957	贝泰妮	213.00	53,667.48	0.02
93	688195	腾景科技	2,693.00	53,509.91	0.02
94	301020	密封科技	4,210.00	44,794.40	0.02
95	601528	瑞丰银行	2,230.00	34,721.10	0.01
96	301021	英诺激光	2,899.00	27,424.54	0.01
97	300973	立高食品	222.00	25,687.62	0.01
98	300953	震裕科技	240.00	23,964.00	0.01
99	301009	可靠股份	713.00	19,885.57	0.01
100	301015	百洋医药	462.00	17,939.46	0.01
101	688226	威腾电气	2,693.00	17,289.06	0.01
102	300981	中红医疗	189.00	17,083.71	0.01
103	300932	三友联众	492.00	15,601.32	0.01
104	300982	苏文电能	317.00	14,356.93	0.01
105	001208	华菱线缆	1,754.00	13,558.42	0.01
106	300940	南极光	307.00	13,317.66	0.01
107	300937	药易购	244.00	13,105.24	0.01
108	301013	利和兴	471.00	12,768.81	0.01
109	300942	易瑞生物	443.00	12,634.36	0.01

110	300968	格林精密	1,033.00	12,468.31	0.01
111	603171	税友股份	637.00	12,230.40	0.01
112	300997	欢乐家	928.00	12,110.40	0.00
113	300933	中辰股份	1,112.00	11,609.28	0.00
114	301002	崧盛股份	201.00	11,581.62	0.00
115	605287	德才股份	349.00	11,014.44	0.00
116	300955	嘉亨家化	232.00	10,688.24	0.00
117	300996	普联软件	241.00	10,177.43	0.00
118	300956	英力股份	371.00	9,571.80	0.00
119	300962	中金辐照	576.00	9,429.12	0.00
120	300952	恒辉安防	340.00	9,207.20	0.00
121	301016	雷尔伟	275.00	9,069.50	0.00
122	300966	共同药业	286.00	9,020.44	0.00
123	300945	曼卡龙	474.00	8,949.12	0.00
124	300948	冠中生态	324.00	8,884.08	0.00
125	300931	通用电梯	672.00	8,809.92	0.00
126	300961	深水海纳	394.00	8,695.58	0.00
127	300950	德固特	219.00	8,569.47	0.00
128	605162	新中港	1,377.00	8,358.39	0.00
129	300958	建工修复	300.00	8,166.00	0.00
130	300986	志特新材	264.00	8,070.48	0.00
131	300987	川网传媒	301.00	8,069.81	0.00
132	300978	东箭科技	593.00	8,064.80	0.00
133	300926	博俊科技	359.00	7,969.80	0.00
134	300993	玉马遮阳	410.00	7,908.90	0.00
135	300971	博亚精工	245.00	6,931.05	0.00
136	301004	嘉益股份	312.00	6,845.28	0.00
137	300991	创益通	254.00	6,733.54	0.00
138	300927	江天化学	217.00	6,531.70	0.00
139	300975	商络电子	492.00	6,410.76	0.00
140	301011	华立科技	175.00	5,922.00	0.00
141	300943	春晖智控	255.00	5,867.55	0.00
142	300967	晓鸣股份	507.00	5,850.78	0.00
143	300972	万辰生物	430.00	5,439.50	0.00
144	300929	华骐环保	183.00	5,407.65	0.00
145	300960	通业科技	234.00	5,396.04	0.00
146	605011	杭州热电	525.00	4,662.00	0.00
147	301007	德迈仕	303.00	4,375.32	0.00
148	300998	宁波方正	201.00	4,285.32	0.00
149	301012	扬电科技	170.00	4,124.20	0.00
150	301010	晶雪节能	218.00	3,838.98	0.00
151	603606	东方电缆	127.00	2,557.78	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	300676	华大基因	14,361,501.00	4.98
2	600519	贵州茅台	12,997,514.00	4.50
3	600036	招商银行	12,779,062.80	4.43
4	601336	新华保险	10,831,620.00	3.75
5	601166	兴业银行	10,029,237.00	3.48
6	000858	五粮液	9,771,964.66	3.39
7	603369	今世缘	9,231,067.40	3.20
8	601377	兴业证券	8,911,101.00	3.09
9	601628	中国人寿	8,098,157.00	2.81
10	600809	山西汾酒	7,905,819.99	2.74
11	601012	隆基股份	7,623,729.00	2.64
12	601318	中国平安	7,212,043.00	2.50
13	000725	京东方 A	7,079,808.00	2.45
14	601077	渝农商行	6,738,693.00	2.34
15	000100	TCL 科技	6,018,205.00	2.09
16	601398	工商银行	5,838,928.00	2.02
17	600276	恒瑞医药	5,662,740.20	1.96
18	601872	招商轮船	4,987,067.00	1.73
19	002236	大华股份	4,690,702.00	1.63
20	600309	万华化学	4,683,789.00	1.62

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）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	13,703,168.16	4.75
2	601318	中国平安	13,436,260.82	4.66
3	002236	大华股份	11,287,522.00	3.91
4	000568	泸州老窖	10,464,016.00	3.63
5	600036	招商银行	9,878,181.00	3.42
6	601398	工商银行	9,789,103.00	3.39
7	300676	华大基因	9,379,098.00	3.25
8	000858	五粮液	9,325,047.00	3.23
9	601377	兴业证券	9,274,393.00	3.21

10	601336	新华保险	9,220,376.00	3.19
11	601601	中国太保	8,137,140.42	2.82
12	002304	洋河股份	8,112,774.93	2.81
13	600438	通威股份	7,956,490.62	2.76
14	601166	兴业银行	7,828,877.00	2.71
15	600276	恒瑞医药	7,615,494.00	2.64
16	600809	山西汾酒	7,191,088.00	2.49
17	601577	长沙银行	7,089,493.45	2.46
18	600919	江苏银行	6,720,165.07	2.33
19	603369	今世缘	6,640,727.00	2.30
20	000157	中联重科	6,502,280.67	2.25
21	000661	长春高新	6,049,537.00	2.10
22	000333	美的集团	6,000,565.45	2.08

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）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

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	605,448,314.07
卖出股票收入（成交）总额	668,329,384.95

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，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2109	沪深 300 期货 2109 合约	1.00	1,549,920.00	50,460.00	-
公允价值变动总额合计					50,460.00
股指期货投资本期收益					-44,760.00
股指期货投资本期公允价值变动					50,460.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

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

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金无国债期货投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 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

本报告期末本基金未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 (1) “兴业银行”发行人兴业银行股份有限公司因涉及为无证机构提供转接清算服务等五项违法违规行为受到警告处分，中国人民银行福州中心支行没收违法所得 10,875,088.15 元，处以罚款 13,824,431.23 元。（福银罚字〔2020〕35 号，2020 年 9 月 4 日）

(2)“渝农商行”发行人重庆农村商业银行股份有限公司，因未严格监控贷款资金流向致部分贷款被土储机构使用等 5 项违法违规行为，重庆银保监局对该行罚款人民币 180 万元。（渝银保监罚决字〔2020〕42 号，2020 年 9 月 2 日）

另，因通过信托计划回购实现不良资产虚假转让出表、信贷资产风险分类不准确、贷款资金被挪用的违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条（五）项规定，严重违反审慎经营规则，重庆银保监局对该机构罚款 90 万元。（渝银保监罚决字〔2020〕42 号，2020 年 8 月 4 日）

(3)“招商银行”发行人招商银行股份有限公司，因违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财资金池化运作等违规行为，中国银保监会依据《中华人民共和国银行业监督管理法》对该行罚款 7170 万元。（银保监罚决字〔2021〕16 号，2021 年 5 月 17 日）

(4)“贵阳银行”发行人贵阳银行股份有限公司，因账户撤销超过期限报告；未按照规定履行客户身份识别义务；与身份不明的客户进行交易等行为，中国人民银行贵阳中心支行对该行罚款 61.5 万元。（贵银处罚〔2021〕0002 号，2021 年 4 月 15 日）

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券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。

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

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	267,774.83
2	应收证券清算款	507,177.19
3	应收股利	-
4	应收利息	1,856.85
5	应收申购款	1,472,608.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,249,416.93

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.5.2 期末积极投资前五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	600460	士兰微	2,096,220.00	0.86	2021年6月30日，证监会审核公司发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易事项，停牌一天，2021年7月1日起复牌。

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

份额级别	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
新华沪深 300 指数增强 A	2,051	35,638.20	55,287,914.44	75.64%	17,806,024.83	24.36%
新华沪深 300 指数增强 C	3,542	25,711.82	60,063,931.32	65.95%	31,007,324.29	34.05%
合计	5,593	29,351.90	115,351,845.76	70.27%	48,813,349.12	29.73%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	新华沪深 300 指数增强 A	0.00	0.00%
	新华沪深 300 指数增强 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	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	份额级别	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	新华沪深 300 指数增强 A	0
	新华沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华沪深 300 指数增强 A	0
	新华沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华沪深 300 指数增强 A	新华沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 18 日）基金份额总额	134,557,278.04	355,752,417.90
本报告期期初基金份额总额	98,280,090.16	108,575,648.15
本报告期基金总申购份额	7,371,870.39	34,919,340.28
减：本报告期基金总赎回份额	32,558,021.28	52,423,732.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	73,093,939.27	91,071,255.61

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021 年 4 月 9 日，翟晨曦女士担任本基金基金管理人董事长职务，张宗友先生担任本基金基金管理人联席董事长职务。

2021 年 5 月 26 日，于春玲女士担任本基金基金管理人总经理职务。

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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

自 2021 年 1 月 8 日，本基金投资策略增加存托凭证的投资策略。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为进一步维护基金持有人利益，促进会计师事务所提供更优质的服务，2021 年 2 月 1 日本基金会计师事务所由瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）变更为致同会计师事务所（特殊普通合伙）。本次变更事项经本基金管理人董事会审议通过，经基金托管人同意，并已向中国证券监督管理委员会及其派出机构报备。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人本报告期收到重庆证监局出具的行政监管措施，目前已采取措施改进。

本基金托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	225,090,943.84	17.75%	164,607.44	16.93%	-
银河证券	1	218,985,783.14	17.27%	203,941.94	20.98%	-
华安证券	2	169,987,921.42	13.41%	124,312.34	12.79%	-
东北证券	1	135,615,076.44	10.70%	99,175.95	10.20%	-
方正证券	1	134,240,087.50	10.59%	98,168.96	10.10%	-
华创证券	1	122,156,741.83	9.64%	89,333.13	9.19%	-
恒泰证券	2	89,523,481.44	7.06%	65,468.43	6.74%	-
太平洋证券	2	75,011,515.71	5.92%	54,855.90	5.64%	-
安信证券	2	72,721,915.93	5.74%	53,181.27	5.47%	-
华西证券	2	12,511,822.05	0.99%	9,150.00	0.94%	-

广发证券	1	6,387,295.47	0.50%	4,671.12	0.48%	-
国信证券	1	4,501,796.40	0.36%	4,192.38	0.43%	-
国金证券	1	1,036,302.02	0.08%	965.08	0.10%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用23个交易席位，其中报告期内新增0个交易席位，退租0个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

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

二、交易席位的选择流程

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

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

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

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

- 3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、	2021-01-04

		公司网站、电子信披网站	
2	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司基金申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-05
3	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-08
4	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在蚂蚁(杭州)基金销售有限公司基金转换补差费公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-08
5	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-08
6	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在恒泰证券股份有限公司定期定额投资业务起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-16
7	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-01-21
8	新华沪深 300 指数增强型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-01-21
9	新华基金管理股份有限公司基金改聘会计师事务所公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-02-03
10	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在天风证券股份有限公司定期定额投资业务起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-02-26
11	新华基金管理股份有限公司关于旗下新华沪深 300 指数增强型证券投资基金增加北京增财基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2021-03-20
12	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-03-30
13	新华沪深 300 指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2021-03-30
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-03-31
15	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2021-04-10
16	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、	2021-04-21

		公司网站、电子信披网站	
17	新华沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-04-21
18	新华基金管理股份有限公司关于法定代表人变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2021-05-08
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京虹点基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-05-20
20	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-05-27
21	新华基金管理股份有限公司旗下部分基金在平安银行股份有限公司开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-05-27
22	新华基金管理股份有限公司关于在北京植信基金销售有限公司开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-06-26

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华沪深 300 指数增强型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华沪深 300 指数增强型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议
- (四) 新华沪深 300 指数增强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) 《新华沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》（更新）
- (七) 《新华沪深 300 指数增强型证券投资基金产品资料概要》（更新）
- (八) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (九) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (十) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司
二〇二一年八月二十七日