

新华中小市值优选混合型证券投资基金
2020 年中期报告
2020 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

报告送出日期：二〇二〇年八月二十七日

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 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	错误!未定义书签。
2.2 基金产品说明	错误!未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人	错误!未定义书签。
2.4 信息披露方式	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料	错误!未定义书签。
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	错误!未定义书签。
3.2 基金净值表现	错误!未定义书签。
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	错误!未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	错误!未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	错误!未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	错误!未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	错误!未定义书签。
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	错误!未定义书签。
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	错误!未定义书签。
6.2 利润表	错误!未定义书签。
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	错误!未定义书签。
6.4 报表附注	错误!未定义书签。
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	错误!未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
7.4 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	错误!未定义书签。
7.5 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	错误!未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动	错误!未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合	错误!未定义书签。
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债券投资明细	错误!未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	错误!未定义书签。
7.10 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	错误!未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	错误!未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	错误!未定义书签。
7.13 投资组合报告附注	错误!未定义书签。
8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	错误!未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	错误!未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
9 开放式基金份额变动.....	49
10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误!未定义书签。
10.8 其他重大事件	错误!未定义书签。
11 影响投资者决策的其他重要信息	53
12 备查文件目录.....	错误!未定义书签。
12.1 备查文件目录	错误!未定义书签。
12.2 存放地点	错误!未定义书签。
12.3 查阅方式	错误!未定义书签。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华中小市值优选混合型证券投资基金
基金简称	新华中小市值优选混合
基金主代码	519097
交易代码	519097
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 28 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	37,747,192.37 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资，力求实现基金净值增长率持续地超越业绩比较基准。
投资策略	资产配置策略：本基金采用战略性资产配置与战术性资产配置相结合的策略，即在各类资产的投资比例范围内，持续评估各类资产的风险收益状况，并据此动态调整资产配置比例，以从变化的市场环境下最大程度地获利。 股票投资策略：本基金以合理价格成长选股策略（GARP）为核心，精选各行业中具有高成长性且价格合理的中小市值股票进行投资。债券投资策略：本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。
业绩比较基准	80%×中证 700 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金资产整体的预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	李申
	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	北京市西城区闹市口大街1号

	力帆中心2号楼19层	院1号楼
邮政编码	400010	100033
法定代表人	张宗友	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	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区太平桥大街 17 号

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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	21,814,772.89
本期利润	23,953,168.71
加权平均基金份额本期利润	0.5926
本期加权平均净值利润率	28.08%
本期基金份额净值增长率	32.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	49,094,068.12
期末可供分配基金份额利润	1.3006
期末基金资产净值	94,342,712.35
期末基金份额净值	2.499
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	257.00%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.61%	1.29%	7.56%	0.71%	4.05%	0.58%
过去三个月	27.05%	1.50%	13.53%	0.88%	13.52%	0.62%
过去六个月	32.15%	2.08%	10.07%	1.39%	22.08%	0.69%
过去一年	68.51%	1.70%	18.51%	1.13%	50.00%	0.57%
过去三年	74.51%	1.62%	5.32%	1.13%	69.19%	0.49%
自基金合同生效起至今	257.00%	1.51%	33.72%	1.30%	223.28%	0.21%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中证 700 指数收益率，债券投资部分的业绩比较基准选择上证国债指数收益率，复合业绩比较基准为 80%×中证 700 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

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

新华中小市值优选混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2011 年 1 月 28 日至 2020 年 6 月 30 日）



注：1、本基金于 2011 年 1 月 28 日基金合同生效。

2、本报告期末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 2020 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十五只开放式基金，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分级证券投资基金、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 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）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
付伟	本基金基金经理，新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016-06-17	-	10	西安交通大学工学硕士，北京大学工商管理硕士，历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理，新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与 TMT 组组长，先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。

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中小市值优选混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华中小市值优选混合型证券投资基金基金合同》以及其

它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年 A 股大盘呈现震荡向上走势，与新冠疫情关系密切的生物医药板块表现出色，受益于经济内循环的科技和消费板块表现也较好。本基金根据基金合同约定，精选各个行业中具有较高成长性且估值合理的中小市值股票进行投资，追求获取长期超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.499 元，本报告期份额净值增长率为 32.15%，同期比较基准的增长率为 10.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年上半年全球经济受到新冠疫情冲击，中国政府积极采取各项措施，及时控制住了疫情蔓延的态势，复工复产有序进行中。展望下半年，国内经济状况将逐渐改善，企业盈利趋势向好。

本基金将继续保持较高仓位，注意把握其中的结构性机会，更多关注景气度处于底部复苏或持续提升的产业机会。考虑到复工复产持续推进，疫苗研发进展良好，行业配置新增前期受疫情影响损失较大的顺周期行业，中长期继续关注受益于产业政策强力支持的科技，以及受益于国内广阔市场的消费。个股选择上，重点布局调整充分，业绩稳健，估值处于较低水平，成长性良好的个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、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、投资管理部门、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。

二、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门相互独立。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。

三、投资管理部门的职责分工

- 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。

四、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。

五、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管理部门问讯；
- 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

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低

于五千万元的情况。

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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人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：新华中小市值优选混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	12,117,185.02	4,076,255.44
结算备付金		1,733,266.64	1,597,576.40
存出保证金		153,342.95	76,872.56
交易性金融资产	6.4.7.2	89,109,080.98	78,698,219.97
其中：股票投资		89,109,080.98	78,698,219.97
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	10,226,437.35
应收利息	6.4.7.5	1,700.05	2,071.49
应收股利		-	-
应收申购款		147,378.90	100,494.28
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		103,261,954.54	94,777,927.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		6,724,306.77	10,092,917.93
应付赎回款		418,382.95	298,903.12
应付管理人报酬		111,608.60	102,106.52
应付托管费		18,601.46	17,017.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,565,781.03	951,127.68
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	80,561.38	160,479.35
负债合计		8,919,242.19	11,622,552.35
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	37,747,192.37	43,978,162.01
未分配利润	6.4.7.10	56,595,519.98	39,177,213.13
所有者权益合计		94,342,712.35	83,155,375.14
负债和所有者权益总计		103,261,954.54	94,777,927.49

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.499 元，基金份额总额 37,747,192.37 份。

6.2 利润表

会计主体：新华中小市值优选混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		27,970,254.72	18,111,318.40
1.利息收入		35,379.75	42,876.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	35,379.75	42,876.46
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		25,754,491.08	16,239,161.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	25,242,798.65	15,967,704.11
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		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	511,692.43	271,457.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,138,395.82	1,772,153.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	41,988.07	57,127.52
减：二、费用		4,017,086.01	2,897,263.70
1. 管理人报酬		638,191.33	518,712.42
2. 托管费		106,365.24	86,452.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	3,188,448.03	2,201,316.70
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	6.4.7.18	84,081.41	90,782.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,953,168.71	15,214,054.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,953,168.71	15,214,054.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华中小市值优选混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	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）	43,978,162.01	39,177,213.13	83,155,375.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,953,168.71	23,953,168.71
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）	-6,230,969.64	-6,534,861.86	-12,765,831.50
其中：1.基金申购款	14,642,147.24	16,073,475.69	30,715,622.93
2.基金赎回款	-20,873,116.88	-22,608,337.55	-43,481,454.43
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）	37,747,192.37	56,595,519.98	94,342,712.35
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	45,521,401.60	6,521,216.93	52,042,618.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,214,054.70	15,214,054.70
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）	2,958,992.99	1,661,633.13	4,620,626.12
其中：1.基金申购款	23,303,431.02	13,463,580.88	36,767,011.90
2.基金赎回款	-20,344,438.03	-11,801,947.75	-32,146,385.78
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）	48,480,394.59	23,396,904.76	71,877,299.35

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：张宗友，主管会计工作负责人：刘全胜，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

新华中小市值优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]1403 号文件“关于核准新华中小市值优选混合型证券投资基金募集的批复”,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2011 年 1 月 4 日至 1 月 25 日向社会公开募集,首次募集资金总额 742,965,884.43 元,其中募集净认购资金金额 742,773,420.20 元,募集资金产生利息 192,464.23 元,并经国富浩华会计师事务所(特殊普通合伙)浩华验字[2011]第 1 号验资报告予以验证。2011 年 1 月 28 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。

根据《新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书》及《新华中小市值优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于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、债券、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%,其中中小市值股票投资占基金股票资产的比例不低于 80%,债券投资占基金资产的比例范围为 0%-40%,资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0%-20%,权证投资占基金资产净值的比例范围为 0%-3%,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:80%*中证 700 指数收益率+20%*上证国债指数收益率。

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 2020 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础,根据实际发生的交易和事项,按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华中小市值优选混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

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

本报告期所采用的会计政策与上年度一致、会计估计与上年度一致。

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

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》的规定：2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定：对证券投资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，股权的股息、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。

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 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[2016]140 号）、《关于资管产品增值税政策有关

问题的补充通知》(财税[2017]2 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税[2017]90 号)的规定,自 2018 年 1 月 1 日起,证券投资基金在运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法,按照现行规定缴纳增值税及附加税费。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、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》的规定: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。上市公司派发股息红利时,对个人持股 1 年以内(含 1 年)的,上市公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	12,117,185.02
定期存款	-
其他存款	-
合计	12,117,185.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		84,630,294.78	89,109,080.98	4,478,786.20
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	84,630,294.78	89,109,080.98	4,478,786.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	935.95
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	764.10
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	1,700.05

注：应收结算备付金利息中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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,565,781.03
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,565,781.03

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	998.26
应付证券出借违约金	-
预提审计费	39,781.56
预提信息披露费	39,781.56
预提账户维护费	-
合计	80,561.38

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	43,978,162.01	43,978,162.01
本期申购	14,642,147.24	14,642,147.24
本期赎回（以“-”号填列）	-20,873,116.88	-20,873,116.88
本期末	37,747,192.37	37,747,192.37

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,234,207.95	5,943,005.18	39,177,213.13
本期利润	21,814,772.89	2,138,395.82	23,953,168.71
本期基金份额交易产生的变动数	-5,954,912.72	-579,949.14	-6,534,861.86
其中：基金申购款	13,465,920.25	2,607,555.44	16,073,475.69
基金赎回款	-19,420,832.97	-3,187,504.58	-22,608,337.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,094,068.12	7,501,451.86	56,595,519.98

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	19,308.82
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	16,070.93
其他	-
合计	35,379.75

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,186,664,328.56
减：卖出股票成本总额	1,161,421,529.91
买卖股票差价收入	25,242,798.65

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	0.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应收利息总额	-
买卖债券差价收入	-

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	511,692.43
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	511,692.43
----	------------

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	2,138,395.82
——股票投资	2,138,395.82
——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	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	2,138,395.82

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	39,761.71
其它收入_转换费收入	2,226.36
合计	41,988.07

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	3,188,448.03
银行间市场交易费用	-
合计	3,188,448.03

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
账户维护费	-
汇划手续费	4,158.29
其他	360.00
合计	84,081.41

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 2020 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
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	458,980,808.66	19.49%	426,202,580.19	26.19%

公司				
----	--	--	--	--

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无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 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	335,652.68	18.72%	459,162.20	29.32%
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	311,681.15	25.02%	311,681.15	22.49%

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示；

2、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	638,191.33	518,712.42
其中：支付销售机构的客户维护费	291,746.39	250,190.39

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	106,365.24	86,452.12

注: 基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间, 本基金未与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

报告期末, 除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	12,117,185.02	19,308.82	4,342,920.13	30,866.34

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期间无收益分配事项。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	网下中签	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	网下中签	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	网下中签	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止报告期期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末无交易所市场债券正回购余额。

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董事会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约合约责任，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投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.3 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 2020 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	12,117,185.02	-	-	-	12,117,185.02
结算备付金	1,733,266.64	-	-	-	1,733,266.64
存出保证金	153,342.95	-	-	-	153,342.95
交易性金融资产	-	-	-	89,109,080.98	89,109,080.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,700.05	1,700.05
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	147,378.90	147,378.90
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,003,794.61	-	-	89,258,159.93	103,261,954.54
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	-	-	-	6,724,306.77	6,724,306.77
应付赎回款	-	-	-	418,382.95	418,382.95
应付管理人报酬	-	-	-	111,608.60	111,608.60
应付托管费	-	-	-	18,601.46	18,601.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,565,781.03	1,565,781.03
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	80,561.38	80,561.38

负债总计	-	-	-	8,919,242.19	8,919,242.19
利率敏感度缺口	14,003,794.61	-	-	80,338,917.74	94,342,712.35
上年度末 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	4,076,255.44	-	-	-	4,076,255.44
结算备付金	1,597,576.40	-	-	-	1,597,576.40
存出保证金	76,872.56	-	-	-	76,872.56
交易性金融资产	-	-	-	78,698,219.97	78,698,219.97
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,226,437.35	10,226,437.35
应收利息	-	-	-	2,071.49	2,071.49
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	100,494.28	100,494.28
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,750,704.40	-	-	89,027,223.09	94,777,927.49
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	-	-	-	10,092,917.93	10,092,917.93
应付赎回款	-	-	-	298,903.12	298,903.12
应付管理人报酬	-	-	-	102,106.52	102,106.52
应付托管费	-	-	-	17,017.75	17,017.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	951,127.68	951,127.68
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	160,479.35	160,479.35
负债总计	-	-	-	11,622,552.35	11,622,552.35

利率敏感度缺口	5,750,704.40	-	-	77,404,670.74	83,155,375.14
---------	--------------	---	---	---------------	---------------

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	89,109,080.98	94.45	78,698,219.97	94.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	89,109,080.98	94.45	78,698,219.97	94.64

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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	1,059,875.36	821,120.26
	沪深 300 指数下降 1%	-1,059,875.36	-821,120.26

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	89,109,080.98	86.29
	其中：股票	89,109,080.98	86.29
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	13,850,451.66	13.41
8	其他各项资产	302,421.90	0.29
9	合计	103,261,954.54	100.00

7.2 报告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	3,152,300.00	3.34
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,642,800.09	56.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,598,547.00	2.75
G	交通运输、仓储和邮政业	3,225,215.00	3.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,511,081.57	20.68
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,322,220.00	2.46
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,450,794.00	1.54
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	3,193,357.00	3.38
S	综合	-	-
	合计	89,109,080.98	94.45

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002241	歌尔股份	131,400	3,857,904.00	4.09
2	002956	西麦食品	33,600	3,662,400.00	3.88
3	603444	吉比特	6,600	3,623,466.00	3.84
4	002317	众生药业	191,600	3,287,856.00	3.49
5	002959	小熊电器	26,700	3,284,100.00	3.48
6	002928	华夏航空	214,300	3,225,215.00	3.42
7	603589	口子窖	63,200	3,216,880.00	3.41

8	603538	美诺华	63,040	3,213,779.20	3.41
9	300251	光线传媒	292,700	3,193,357.00	3.38
10	002299	圣农发展	108,700	3,152,300.00	3.34
11	000625	长安汽车	276,800	3,044,800.00	3.23
12	002371	北方华创	16,800	2,871,288.00	3.04
13	002661	克明面业	123,300	2,858,094.00	3.03
14	002292	奥飞娱乐	335,000	2,820,700.00	2.99
15	300315	掌趣科技	356,200	2,610,946.00	2.77
16	603353	和顺石油	55,300	2,598,547.00	2.75
17	300054	鼎龙股份	155,100	2,574,660.00	2.73
18	000988	华工科技	104,100	2,543,163.00	2.70
19	300136	信维通信	45,200	2,396,504.00	2.54
20	688196	卓越新能	44,946	2,353,372.56	2.49
21	000736	中交地产	346,600	2,322,220.00	2.46
22	603258	电魂网络	37,400	2,077,944.00	2.20
23	688318	财富趋势	6,692	1,900,528.00	2.01
24	600804	鹏博士	205,900	1,848,982.00	1.96
25	002281	光迅科技	56,100	1,843,446.00	1.95
26	600884	杉杉股份	155,600	1,834,524.00	1.94
27	300113	顺网科技	66,500	1,689,100.00	1.79
28	600640	号百控股	77,800	1,552,110.00	1.65
29	002351	漫步者	71,900	1,518,528.00	1.61
30	300657	弘信电子	72,400	1,453,068.00	1.54
31	603127	昭衍新药	13,800	1,450,794.00	1.54
32	300725	药石科技	11,500	1,428,875.00	1.51
33	300031	宝通科技	56,700	1,419,768.00	1.50
34	002624	完美世界	24,600	1,417,944.00	1.50
35	002392	北京利尔	353,200	1,412,800.00	1.50
36	002467	二六三	193,200	1,358,196.00	1.44
37	000799	酒鬼酒	14,400	1,101,744.00	1.17
38	600584	长电科技	32,000	1,000,640.00	1.06
39	603087	甘李药业	258	25,877.40	0.03
40	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
41	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
42	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
43	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
44	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
45	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	002371	北方华创	15,682,038.08	18.86
2	000625	长安汽车	11,827,710.75	14.22
3	300251	光线传媒	11,581,417.00	13.93
4	002241	歌尔股份	11,396,567.00	13.71
5	002959	小熊电器	11,357,363.91	13.66
6	600703	三安光电	11,188,487.35	13.45
7	002739	万达电影	10,834,580.06	13.03
8	688012	中微公司	10,633,889.03	12.79
9	300031	宝通科技	10,383,456.20	12.49
10	688111	金山办公	9,779,350.87	11.76
11	002475	立讯精密	9,353,131.65	11.25
12	300054	鼎龙股份	9,325,974.40	11.22
13	002555	三七互娱	8,941,441.00	10.75
14	002299	圣农发展	8,732,927.87	10.50
15	300750	宁德时代	8,437,868.96	10.15
16	300115	长盈精密	8,312,939.72	10.00
17	002928	华夏航空	8,163,375.23	9.82
18	000401	冀东水泥	8,161,157.17	9.81
19	002956	西麦食品	8,085,679.00	9.72
20	300133	华策影视	8,037,128.40	9.67
21	002223	鱼跃医疗	7,900,931.16	9.50
22	002384	东山精密	7,845,004.60	9.43
23	300413	芒果超媒	7,789,949.20	9.37
24	300315	掌趣科技	7,518,926.57	9.04
25	300426	唐德影视	7,407,584.50	8.91
26	002467	二六三	7,193,403.00	8.65
27	002146	荣盛发展	7,121,149.00	8.56
28	603737	三棵树	7,018,137.00	8.44
29	002156	通富微电	6,800,798.02	8.18
30	000860	顺鑫农业	6,781,232.10	8.15
31	601952	苏垦农发	6,663,916.20	8.01
32	603444	吉比特	6,655,106.00	8.00
33	603158	腾龙股份	6,640,494.00	7.99
34	688018	乐鑫科技	6,618,858.23	7.96
35	002745	木林森	6,492,777.00	7.81
36	300760	迈瑞医疗	6,443,905.00	7.75
37	300027	华谊兄弟	6,436,861.20	7.74
38	300433	蓝思科技	6,431,819.20	7.73
39	600104	上汽集团	6,420,434.23	7.72
40	002301	齐心集团	6,417,537.72	7.72
41	603538	美诺华	6,395,080.20	7.69

42	300059	东方财富	6,345,295.00	7.63
43	002624	完美世界	6,342,037.00	7.63
44	002343	慈文传媒	6,298,913.20	7.57
45	600585	海螺水泥	6,158,394.00	7.41
46	300182	捷成股份	6,128,535.00	7.37
47	600038	中直股份	6,008,556.65	7.23
48	002661	克明面业	5,925,015.00	7.13
49	600809	山西汾酒	5,922,695.00	7.12
50	300655	晶瑞股份	5,904,059.26	7.10
51	000786	北新建材	5,893,510.56	7.09
52	603195	公牛集团	5,809,136.55	6.99
53	002425	凯撒文化	5,761,656.00	6.93
54	600584	长电科技	5,723,964.00	6.88
55	002600	领益智造	5,654,268.00	6.80
56	600801	华新水泥	5,398,255.42	6.49
57	603589	口子窖	5,369,579.00	6.46
58	300497	富祥药业	5,346,218.20	6.43
59	000802	北京文化	5,320,462.00	6.40
60	600373	中文传媒	5,203,134.00	6.26
61	000596	古井贡酒	5,176,437.00	6.23
62	002190	成飞集成	5,159,896.92	6.21
63	002304	洋河股份	5,134,643.65	6.17
64	688008	澜起科技	5,128,498.87	6.17
65	600986	科达股份	5,067,494.20	6.09
66	688233	神工股份	4,952,792.36	5.96
67	601633	长城汽车	4,947,517.00	5.95
68	300207	欣旺达	4,915,381.98	5.91
69	000799	酒鬼酒	4,912,963.96	5.91
70	600088	中视传媒	4,873,179.08	5.86
71	002281	光迅科技	4,824,632.43	5.80
72	002409	雅克科技	4,806,151.00	5.78
73	300136	信维通信	4,654,962.00	5.60
74	002185	华天科技	4,519,168.00	5.43
75	688318	财富趋势	4,433,084.32	5.33
76	000338	潍柴动力	4,361,835.00	5.25
77	002332	仙琚制药	4,331,307.20	5.21
78	002508	老板电器	4,318,583.00	5.19
79	000425	徐工机械	4,299,857.00	5.17
80	603103	横店影视	4,271,611.14	5.14
81	002938	鹏鼎控股	4,225,236.00	5.08
82	002169	智光电气	4,206,216.82	5.06
83	000021	深科技	4,180,470.00	5.03
84	600315	上海家化	4,178,255.55	5.02
85	300364	中文在线	4,153,738.00	5.00

86	600221	海航控股	4,146,507.00	4.99
87	300188	美亚柏科	4,129,343.21	4.97
88	002829	星网宇达	4,124,978.00	4.96
89	002594	比亚迪	4,077,723.00	4.90
90	600196	复星医药	4,041,625.00	4.86
91	603868	飞科电器	4,014,833.09	4.83
92	300142	沃森生物	3,978,125.00	4.78
93	600893	航发动力	3,923,463.00	4.72
94	002955	鸿合科技	3,848,359.44	4.63
95	603079	圣达生物	3,828,133.00	4.60
96	002001	新 和 成	3,821,712.57	4.60
97	603353	和顺石油	3,798,309.82	4.57
98	600496	精工钢构	3,769,474.00	4.53
99	300003	乐普医疗	3,769,337.00	4.53
100	300571	平治信息	3,761,383.00	4.52
101	002717	岭南股份	3,748,107.00	4.51
102	600831	广电网络	3,723,033.00	4.48
103	600580	卧龙电驱	3,702,870.00	4.45
104	000063	中兴通讯	3,672,358.00	4.42
105	600068	葛洲坝	3,662,040.00	4.40
106	300220	金运激光	3,650,268.00	4.39
107	600588	用友网络	3,582,100.60	4.31
108	002568	百润股份	3,564,799.62	4.29
109	000547	航天发展	3,534,848.00	4.25
110	300037	新宙邦	3,486,569.00	4.19
111	603019	中科曙光	3,458,111.40	4.16
112	300518	盛讯达	3,457,502.00	4.16
113	601168	西部矿业	3,414,734.00	4.11
114	002558	巨人网络	3,377,628.88	4.06
115	002602	世纪华通	3,373,040.63	4.06
116	002351	漫步者	3,348,853.00	4.03
117	000656	金科股份	3,343,121.00	4.02
118	002541	鸿路钢构	3,337,837.09	4.01
119	600760	中航沈飞	3,337,816.00	4.01
120	688015	交控科技	3,311,805.67	3.98
121	603809	豪能股份	3,300,306.23	3.97
122	002897	意华股份	3,299,430.20	3.97
123	000977	浪潮信息	3,294,271.00	3.96
124	688258	卓易信息	3,288,391.36	3.95
125	603825	华扬联众	3,253,233.00	3.91
126	002157	正邦科技	3,219,526.00	3.87
127	600867	通化东宝	3,188,104.00	3.83
128	600109	国金证券	3,169,939.00	3.81
129	300299	富春股份	3,148,025.00	3.79

130	300044	赛为智能	3,128,406.10	3.76
131	600133	东湖高新	3,115,687.45	3.75
132	600521	华海药业	3,078,061.00	3.70
133	002273	水晶光电	3,073,909.00	3.70
134	300033	同花顺	3,061,834.00	3.68
135	600637	东方明珠	2,991,975.78	3.60
136	603127	昭衍新药	2,969,696.60	3.57
137	002517	恺英网络	2,959,283.50	3.56
138	002655	共达电声	2,936,257.00	3.53
139	600984	建设机械	2,895,566.00	3.48
140	002084	海鸥住工	2,888,385.00	3.47
141	002317	众生药业	2,874,740.00	3.46
142	002827	高争民爆	2,874,435.50	3.46
143	002432	九安医疗	2,856,856.36	3.44
144	600297	广汇汽车	2,825,217.00	3.40
145	300702	天宇股份	2,790,893.80	3.36
146	300233	金城医药	2,785,004.00	3.35
147	603615	茶花股份	2,774,498.00	3.34
148	600745	闻泰科技	2,769,329.00	3.33
149	600640	号百控股	2,755,547.00	3.31
150	603690	至纯科技	2,734,565.00	3.29
151	688368	晶丰明源	2,734,213.36	3.29
152	600085	同仁堂	2,712,223.00	3.26
153	300063	天龙集团	2,699,550.00	3.25
154	600050	中国联通	2,688,000.00	3.23
155	601231	环旭电子	2,635,147.00	3.17
156	601186	XD 中国铁	2,586,970.00	3.11
157	300556	丝路视觉	2,585,674.00	3.11
158	688033	天宜上佳	2,580,583.42	3.10
159	600136	当代文体	2,580,201.00	3.10
160	002129	中环股份	2,577,576.00	3.10
161	688168	安博通	2,576,649.82	3.10
162	600859	王府井	2,566,531.70	3.09
163	002376	新北洋	2,562,860.00	3.08
164	603496	恒为科技	2,557,624.96	3.08
165	603369	今世缘	2,553,019.00	3.07
166	603886	元祖股份	2,549,337.00	3.07
167	600597	光明乳业	2,548,033.38	3.06
168	600855	航天长峰	2,540,617.00	3.06
169	688300	联瑞新材	2,534,714.72	3.05
170	600515	海航基础	2,501,931.00	3.01
171	002126	银轮股份	2,489,370.00	2.99
172	002292	奥飞娱乐	2,488,226.96	2.99
173	600037	歌华有线	2,461,590.00	2.96

174	300284	苏交科	2,456,816.00	2.95
175	603466	风语筑	2,432,210.00	2.92
176	300052	中青宝	2,430,337.00	2.92
177	601899	紫金矿业	2,430,000.00	2.92
178	002030	达安基因	2,429,831.00	2.92
179	603358	华达科技	2,423,060.72	2.91
180	603777	来伊份	2,418,336.00	2.91
181	603929	亚翔集成	2,407,757.00	2.90
182	300578	会畅通讯	2,391,239.00	2.88
183	600750	江中药业	2,369,774.00	2.85
184	000736	中交地产	2,367,592.50	2.85
185	600766	园城黄金	2,365,153.00	2.84
186	600168	武汉控股	2,325,317.00	2.80
187	002131	利欧股份	2,321,000.00	2.79
188	002389	航天彩虹	2,314,689.00	2.78
189	300242	佳云科技	2,309,226.00	2.78
190	002732	燕塘乳业	2,297,959.00	2.76
191	000988	华工科技	2,292,900.70	2.76
192	002382	蓝帆医疗	2,287,857.00	2.75
193	002074	国轩高科	2,281,660.24	2.74
194	300397	天和防务	2,281,401.00	2.74
195	603018	中设集团	2,268,713.90	2.73
196	300482	万孚生物	2,266,309.00	2.73
197	002240	威华股份	2,265,051.00	2.72
198	300771	智莱科技	2,249,287.00	2.70
199	300113	顺网科技	2,240,303.19	2.69
200	002910	庄园牧场	2,230,809.00	2.68
201	603608	天创时尚	2,217,457.40	2.67
202	688196	卓越新能	2,204,365.48	2.65
203	600332	白云山	2,198,956.00	2.64
204	002320	海峡股份	2,182,579.00	2.62
205	300459	金科文化	2,180,000.00	2.62
206	002702	海欣食品	2,179,476.60	2.62
207	688358	祥生医疗	2,156,270.14	2.59
208	002867	周大生	2,153,221.00	2.59
209	688369	致远互联	2,147,209.18	2.58
210	603833	欧派家居	2,140,441.86	2.57
211	300049	福瑞股份	2,136,730.00	2.57
212	000793	华闻集团	2,135,748.00	2.57
213	600523	贵航股份	2,124,077.25	2.55
214	603630	拉芳家化	2,123,706.00	2.55
215	603367	辰欣药业	2,122,093.75	2.55
216	603533	掌阅科技	2,117,452.00	2.55
217	002811	郑中设计	2,088,440.00	2.51

218	600419	天润乳业	2,071,818.40	2.49
219	603516	淳中科技	2,070,250.00	2.49
220	603020	爱普股份	2,056,981.00	2.47
221	603598	引力传媒	2,056,079.00	2.47
222	002075	沙钢股份	2,051,330.00	2.47
223	300601	康泰生物	2,021,335.65	2.43
224	600380	健康元	2,007,513.00	2.41
225	300058	蓝色光标	1,998,566.90	2.40
226	300465	高伟达	1,986,904.00	2.39
227	300639	凯普生物	1,979,111.40	2.38
228	300599	雄塑科技	1,976,682.00	2.38
229	600702	舍得酒业	1,951,646.94	2.35
230	002250	联化科技	1,948,796.26	2.34
231	002572	索菲亚	1,939,767.00	2.33
232	002230	科大讯飞	1,939,155.52	2.33
233	300124	汇川技术	1,938,869.00	2.33
234	002063	远光软件	1,922,040.00	2.31
235	688081	兴图新科	1,914,479.26	2.30
236	603078	江化微	1,897,450.64	2.28
237	300204	舒泰神	1,882,605.22	2.26
238	603258	电魂网络	1,882,340.00	2.26
239	600522	中天科技	1,865,365.00	2.24
240	600804	鹏博士	1,864,097.00	2.24
241	600720	祁连山	1,862,874.00	2.24
242	603606	东方电缆	1,862,425.48	2.24
243	600884	杉杉股份	1,857,181.35	2.23
244	002481	双塔食品	1,841,224.00	2.21
245	300674	宇信科技	1,833,060.00	2.20
246	601066	中信建投	1,827,755.00	2.20
247	002605	姚记科技	1,808,147.00	2.17
248	300271	华宇软件	1,790,319.66	2.15
249	688169	石头科技	1,771,626.01	2.13
250	603501	韦尔股份	1,751,933.00	2.11
251	002155	湖南黄金	1,749,602.98	2.10
252	000848	承德露露	1,732,131.24	2.08
253	688009	中国通号	1,729,148.02	2.08
254	300703	创源文化	1,725,736.50	2.08
255	688088	虹软科技	1,724,163.10	2.07
256	603489	八方股份	1,705,759.00	2.05
257	000998	隆平高科	1,697,126.00	2.04
258	300463	迈克生物	1,695,111.48	2.04
259	600197	伊力特	1,693,799.00	2.04
260	688002	睿创微纳	1,691,186.57	2.03
261	300381	溢多利	1,688,980.00	2.03

262	688036	传音控股	1,686,954.03	2.03
263	688222	成都先导	1,683,425.83	2.02
264	600872	中炬高新	1,673,761.00	2.01
265	603613	国联股份	1,670,987.85	2.01
266	600031	三一重工	1,668,000.00	2.01

注：本项“买入金额”按买入成交金额(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	300251	光线传媒	13,143,141.18	15.81
2	002371	北方华创	12,790,731.72	15.38
3	002146	荣盛发展	12,091,809.92	14.54
4	300413	芒果超媒	11,853,572.04	14.25
5	688012	中微公司	11,539,322.19	13.88
6	600703	三安光电	11,405,518.00	13.72
7	600801	华新水泥	10,629,409.80	12.78
8	688111	金山办公	10,460,245.81	12.58
9	002425	凯撒文化	10,309,649.00	12.40
10	002739	万达电影	10,122,222.48	12.17
11	002156	通富微电	9,818,182.11	11.81
12	600584	长电科技	9,743,918.00	11.72
13	002555	三七互娱	9,363,214.35	11.26
14	000625	长安汽车	9,113,785.90	10.96
15	300031	宝通科技	9,006,672.00	10.83
16	300750	宁德时代	9,006,143.03	10.83
17	002475	立讯精密	8,830,311.89	10.62
18	002959	小熊电器	8,827,392.00	10.62
19	600068	葛洲坝	8,711,872.00	10.48
20	002241	歌尔股份	8,277,743.00	9.95
21	000401	冀东水泥	8,173,677.45	9.83
22	002384	东山精密	7,636,628.00	9.18
23	300115	长盈精密	7,619,030.76	9.16
24	002223	鱼跃医疗	7,574,701.62	9.11
25	300133	华策影视	7,526,059.36	9.05
26	603158	腾龙股份	7,137,706.00	8.58
27	300426	唐德影视	7,083,638.00	8.52
28	300760	迈瑞医疗	7,045,648.45	8.47
29	603737	三棵树	6,939,160.00	8.34
30	002301	齐心集团	6,903,850.50	8.30

31	300059	东方财富	6,831,410.58	8.22
32	300054	鼎龙股份	6,748,990.00	8.12
33	300136	信维通信	6,681,688.45	8.04
34	600104	上汽集团	6,606,818.36	7.95
35	600585	海螺水泥	6,590,431.66	7.93
36	601952	苏垦农发	6,526,997.87	7.85
37	000860	顺鑫农业	6,413,670.00	7.71
38	300433	蓝思科技	6,395,894.30	7.69
39	000802	北京文化	6,382,825.00	7.68
40	688018	乐鑫科技	6,285,470.53	7.56
41	000786	北新建材	6,229,683.06	7.49
42	002745	木林森	6,216,061.44	7.48
43	300027	华谊兄弟	6,156,679.74	7.40
44	300182	捷成股份	6,144,210.00	7.39
45	601336	新华保险	6,018,074.73	7.24
46	002343	慈文传媒	5,993,264.00	7.21
47	600809	山西汾酒	5,976,648.50	7.19
48	600038	中直股份	5,902,628.16	7.10
49	002299	圣农发展	5,902,432.05	7.10
50	000799	酒鬼酒	5,893,777.00	7.09
51	688008	澜起科技	5,855,446.01	7.04
52	300497	富祥药业	5,816,911.00	7.00
53	002956	西麦食品	5,678,552.00	6.83
54	603195	公牛集团	5,661,084.45	6.81
55	603079	圣达生物	5,627,392.22	6.77
56	002467	二六三	5,619,610.00	6.76
57	603444	吉比特	5,540,574.00	6.66
58	600088	中视传媒	5,540,272.42	6.66
59	600373	中文传媒	5,492,412.00	6.60
60	002600	领益智造	5,459,152.00	6.57
61	300315	掌趣科技	5,455,235.00	6.56
62	300655	晶瑞股份	5,427,379.00	6.53
63	000596	古井贡酒	5,134,950.29	6.18
64	002928	华夏航空	5,113,095.00	6.15
65	002624	完美世界	5,058,870.77	6.08
66	002304	洋河股份	5,022,152.00	6.04
67	002190	成飞集成	4,995,685.70	6.01
68	600986	科达股份	4,973,847.80	5.98
69	300207	欣旺达	4,928,784.00	5.93
70	601555	东吴证券	4,915,470.00	5.91
71	002142	宁波银行	4,827,657.00	5.81
72	603228	景旺电子	4,817,219.06	5.79
73	002409	雅克科技	4,810,401.70	5.78
74	601633	长城汽车	4,795,214.00	5.77

75	600859	王府井	4,734,155.94	5.69
76	688233	神工股份	4,673,172.20	5.62
77	600885	宏发股份	4,666,461.17	5.61
78	002332	仙琚制药	4,659,230.00	5.60
79	300364	中文在线	4,629,258.49	5.57
80	600315	上海家化	4,587,138.00	5.52
81	002185	华天科技	4,545,837.78	5.47
82	300033	同花顺	4,483,049.00	5.39
83	300299	富春股份	4,421,160.29	5.32
84	002955	鸿合科技	4,401,284.20	5.29
85	600196	复星医药	4,380,164.00	5.27
86	300188	美亚柏科	4,378,858.08	5.27
87	000338	潍柴动力	4,298,092.28	5.17
88	300142	沃森生物	4,252,384.00	5.11
89	603103	横店影视	4,226,197.02	5.08
90	002508	老板电器	4,226,038.36	5.08
91	002717	岭南股份	4,218,165.00	5.07
92	000021	深科技	4,143,723.00	4.98
93	002938	鹏鼎控股	4,131,235.80	4.97
94	000425	徐工机械	4,117,957.00	4.95
95	002594	比亚迪	4,087,440.00	4.92
96	600221	海航控股	4,040,500.00	4.86
97	002169	智光电气	3,941,284.00	4.74
98	002001	新 和 成	3,918,044.00	4.71
99	002829	星网宇达	3,903,409.00	4.69
100	603868	飞科电器	3,896,566.00	4.69
101	600893	航发动力	3,871,990.00	4.66
102	300003	乐普医疗	3,857,412.00	4.64
103	600588	用友网络	3,856,617.84	4.64
104	601658	邮储银行	3,839,597.94	4.62
105	002541	鸿路钢构	3,753,754.32	4.51
106	002568	百润股份	3,684,628.00	4.43
107	600580	卧龙电驱	3,673,767.00	4.42
108	600496	精工钢构	3,662,930.00	4.40
109	600640	号百控股	3,658,529.00	4.40
110	000977	浪潮信息	3,643,189.00	4.38
111	600831	广电网络	3,624,563.08	4.36
112	000547	航天发展	3,619,012.00	4.35
113	603019	中科曙光	3,566,959.62	4.29
114	600867	通化东宝	3,503,774.02	4.21
115	000063	中兴通讯	3,503,623.00	4.21
116	601168	西部矿业	3,444,643.00	4.14
117	002602	世纪华通	3,426,590.55	4.12
118	300518	盛讯达	3,388,740.00	4.08

119	300037	新宙邦	3,383,632.00	4.07
120	002558	巨人网络	3,349,284.13	4.03
121	600760	中航沈飞	3,342,922.00	4.02
122	300220	金运激光	3,341,228.00	4.02
123	688258	卓易信息	3,335,778.87	4.01
124	603538	美诺华	3,332,427.00	4.01
125	300571	平治信息	3,330,132.00	4.00
126	600637	东方明珠	3,322,559.04	4.00
127	300578	会畅通讯	3,310,409.00	3.98
128	600133	东湖高新	3,295,200.00	3.96
129	000656	金科股份	3,286,518.00	3.95
130	688015	交控科技	3,261,115.10	3.92
131	002661	克明面业	3,256,555.00	3.92
132	002897	意华股份	3,225,602.40	3.88
133	600523	贵航股份	3,190,062.00	3.84
134	603825	华扬联众	3,155,589.00	3.79
135	603809	豪能股份	3,124,891.64	3.76
136	600521	华海药业	3,122,763.00	3.76
137	600109	国金证券	3,070,866.82	3.69
138	300044	赛为智能	3,070,342.94	3.69
139	600745	闻泰科技	3,023,436.00	3.64
140	600984	建设机械	3,010,428.00	3.62
141	002273	水晶光电	2,996,944.00	3.60
142	300702	天宇股份	2,978,359.00	3.58
143	603496	恒为科技	2,975,893.90	3.58
144	002281	光迅科技	2,960,656.00	3.56
145	002827	高争民爆	2,918,471.00	3.51
146	002084	海鸥住工	2,908,085.70	3.50
147	002157	正邦科技	2,895,481.00	3.48
148	600750	江中药业	2,813,637.20	3.38
149	688368	晶丰明源	2,806,910.05	3.38
150	002389	航天彩虹	2,801,095.00	3.37
151	300771	智莱科技	2,790,391.00	3.36
152	002432	九安医疗	2,789,277.06	3.35
153	601186	XD 中国铁	2,775,712.00	3.34
154	688369	致远互联	2,764,338.15	3.32
155	002655	共达电声	2,721,397.00	3.27
156	002030	达安基因	2,708,000.00	3.26
157	600050	中国联通	2,694,791.36	3.24
158	688126	沪硅产业	2,687,397.93	3.23
159	600597	光明乳业	2,669,413.00	3.21
160	603358	华达科技	2,642,377.00	3.18
161	002517	恺英网络	2,621,073.00	3.15
162	603369	今世缘	2,612,547.03	3.14

163	603615	茶花股份	2,601,035.00	3.13
164	002376	新北洋	2,590,297.52	3.12
165	300233	金城医药	2,588,944.00	3.11
166	002126	银轮股份	2,588,390.00	3.11
167	603690	至纯科技	2,588,358.00	3.11
168	600085	同仁堂	2,570,719.63	3.09
169	002129	中环股份	2,555,619.00	3.07
170	600297	广汇汽车	2,552,139.00	3.07
171	600037	歌华有线	2,549,848.00	3.07
172	603777	来伊份	2,542,887.20	3.06
173	600855	航天长峰	2,540,618.00	3.06
174	600766	园城黄金	2,531,172.00	3.04
175	002732	燕塘乳业	2,517,429.00	3.03
176	002131	利欧股份	2,511,652.99	3.02
177	603886	元祖股份	2,479,119.00	2.98
178	600556	天下秀	2,474,866.00	2.98
179	300063	天龙集团	2,471,304.00	2.97
180	002382	蓝帆医疗	2,441,767.00	2.94
181	300556	丝路视觉	2,441,041.00	2.94
182	688033	天宜上佳	2,431,452.61	2.92
183	688318	财富趋势	2,415,415.99	2.90
184	600136	当代文体	2,414,885.00	2.90
185	300124	汇川技术	2,406,830.76	2.89
186	300284	苏交科	2,395,304.24	2.88
187	603466	风语筑	2,378,737.82	2.86
188	601899	紫金矿业	2,371,262.00	2.85
189	603589	口子窖	2,367,181.00	2.85
190	002075	沙钢股份	2,339,775.25	2.81
191	688168	安博通	2,339,085.75	2.81
192	300052	中青宝	2,330,329.00	2.80
193	688300	联瑞新材	2,328,252.15	2.80
194	603929	亚翔集成	2,286,858.00	2.75
195	600515	海航基础	2,285,494.00	2.75
196	300740	御家汇	2,278,369.00	2.74
197	002320	海峡股份	2,267,462.84	2.73
198	002240	威华股份	2,261,121.00	2.72
199	300204	舒泰神	2,250,935.00	2.71
200	603018	中设集团	2,240,754.00	2.69
201	601231	环旭电子	2,233,042.99	2.69
202	600380	健康元	2,230,005.00	2.68
203	300599	雄塑科技	2,223,921.00	2.67
204	300482	万孚生物	2,221,401.28	2.67
205	002702	海欣食品	2,210,252.00	2.66
206	002910	庄园牧场	2,206,987.00	2.65

207	002867	周大生	2,199,819.00	2.65
208	600332	白云山	2,198,735.00	2.64
209	300078	思创医惠	2,173,622.00	2.61
210	600168	武汉控股	2,169,443.00	2.61
211	002074	国轩高科	2,165,930.00	2.60
212	603598	引力传媒	2,157,489.00	2.59
213	603533	掌阅科技	2,149,460.00	2.58
214	300049	福瑞股份	2,147,019.00	2.58
215	300397	天和防务	2,096,484.00	2.52
216	000793	华闻集团	2,095,764.00	2.52
217	300459	金科文化	2,094,000.00	2.52
218	600419	天润乳业	2,092,309.80	2.52
219	300674	宇信科技	2,090,263.00	2.51
220	603516	淳中科技	2,077,415.00	2.50
221	688081	兴图新科	2,070,117.86	2.49
222	600522	中天科技	2,053,768.00	2.47
223	300242	佳云科技	2,052,169.00	2.47
224	603833	欧派家居	2,050,430.60	2.47
225	300465	高伟达	2,047,229.00	2.46
226	002811	郑中设计	2,044,703.00	2.46
227	002250	联化科技	2,025,808.00	2.44
228	603630	拉芳家化	2,016,707.00	2.43
229	600702	舍得酒业	1,987,975.15	2.39
230	688358	祥生医疗	1,980,000.00	2.38
231	603608	天创时尚	1,977,014.00	2.38
232	002605	姚记科技	1,971,472.00	2.37
233	300639	凯普生物	1,962,053.00	2.36
234	002572	索菲亚	1,950,595.65	2.35
235	600031	三一重工	1,950,040.00	2.35
236	300058	蓝色光标	1,942,766.00	2.34
237	300601	康泰生物	1,940,990.54	2.33
238	002230	科大讯飞	1,939,285.56	2.33
239	603020	爱普股份	1,933,708.00	2.33
240	002481	双塔食品	1,893,888.59	2.28
241	002351	漫步者	1,887,290.00	2.27
242	300271	华宇软件	1,881,270.00	2.26
243	603367	辰欣药业	1,871,534.30	2.25
244	603613	国联股份	1,805,060.00	2.17
245	002063	远光软件	1,799,045.42	2.16
246	601066	中信建投	1,790,948.00	2.15
247	600720	祁连山	1,777,804.00	2.14
248	300703	创源文化	1,767,989.75	2.13
249	603697	有友食品	1,755,015.00	2.11
250	600996	贵广网络	1,749,501.00	2.10

251	002155	湖南黄金	1,740,000.00	2.09
252	300463	迈克生物	1,735,590.00	2.09
253	688169	石头科技	1,723,236.86	2.07
254	000936	华西股份	1,711,965.00	2.06
255	688088	虹软科技	1,689,906.74	2.03
256	603801	志邦家居	1,678,560.00	2.02

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额（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

买入股票的成本（成交）总额	1,169,693,995.10
卖出股票的收入（成交）总额	1,186,664,328.56

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

本报告期末本基金无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期末本基金投资的前十名证券没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期末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。

7.12.3 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	153,342.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,700.05
5	应收申购款	147,378.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	302,421.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
4,022	9,385.18	0.00	0.00%	37,747,192.37	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	59,696.92	0.16%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 1 月 28 日）基金份额总额	742,965,884.43
本报告期期初基金份额总额	43,978,162.01

本报告期基金总申购份额	14,642,147.24
减：本报告期基金总赎回份额	20,873,116.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	37,747,192.37

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，本基金基金管理人聘任翟晨曦女士担任公司董事职务，胡湘先生、刘成伟先生担任公司独立董事职务，副总经理崔建波、晏益民离任。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

大同证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	484,439,179.89	20.57%	354,270.79	19.76%	-
恒泰证券	2	458,980,808.66	19.49%	335,652.68	18.72%	-
华安证券	2	303,543,883.62	12.89%	221,982.20	12.38%	-
银河证券	1	270,872,056.38	11.50%	252,263.22	14.07%	-
中信建投证券	1	256,306,619.09	10.88%	187,438.13	10.45%	-
广发证券	1	226,492,789.27	9.62%	165,632.72	9.24%	-
安信证券	2	129,533,246.43	5.50%	94,727.82	5.28%	-
东北证券	1	74,054,679.45	3.14%	54,156.22	3.02%	-
华西证券	2	70,465,216.24	2.99%	51,530.83	2.87%	-
国金证券	1	63,958,175.12	2.72%	59,564.19	3.32%	-
申银万国	1	16,767,587.81	0.71%	15,615.67	0.87%	-

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 22 个交易席位，其中报告期内新增 7 个交易席位，退租 0 个交易席位。其中新增席位为：华安证券上海席位、华西证券上海席位、安信证券上海席位、大同证券上海席位、华安证券深圳席位、华西证券深圳席位、大同证券深圳席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

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

二、交易席位的选择流程

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

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

- 2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，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旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	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	2020-01-02
2	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国农业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	2020-01-10
3	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司调整基金最低申购金额的公告	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	2020-01-10
4	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 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	2020-01-20
5	新华中小市值优选混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-01-20
6	新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书（更新）全文	公司网站、电子信披网站	2020-03-13
7	新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2020-03-13
8	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 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	2020-03-26
9	新华中小市值优选混合型证券投资基金 2019 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2020-03-26
10	新华基金管理股份有限公司关于董事及独董变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-03-27
11	新华基金管理股份有限公司关于参加恒泰证券股份有限公司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	2020-04-08
12	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 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、公司网站、电子信披网站	2020-04-21
13	新华中小市值优选混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-04-21

14	新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2020-04-30
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加民商基金销售(上海)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	2020-05-27
16	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	2020-06-06
17	新华基金管理股份有限公司关于取消武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构的公告的公告	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	2020-06-20
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益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	2020-06-24
19	新华基金管理股份有限公司关于取消厦门市鑫鼎盛控股有限公司为销售机构的公告的公告	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	2020-06-30

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

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他信息。

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中小市值优选混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华中小市值优选混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华中小市值优选混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华中小市值优选混合型证券投资基金基金合同
- (五) 新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六) 更新的《新华中小市值优选混合型证券投资基金招募说明书》
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (九) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

(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

二〇二〇年八月二十七日