

新华优选分红混合型证券投资基金
2020 年年度报告
2020 年 12 月 31 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。致同会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	18
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层对财务报表的责任	18
6.5 注册会计师的责任	19
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.12 本报告期投资基金情况	58
8.13 投资组合报告附注	58
§9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	59
§10 开放式基金份额变动	59
§11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	60
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.9 其他重大事件	64
12 影响投资者决策的其他重要信息	67
§13 备查文件目录	67
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	68
13.3 查阅方式	68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华优选分红混合型证券投资基金	
基金简称	新华优选分红混合	
基金主代码	519087	
交易代码	519087(前端)	519088(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005 年 9 月 16 日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,275,492,399.22 份	

2.2 基金产品说明

投资目标	有效地控制风险，实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准并提供稳定的分红。
投资策略	采用战术型资产配置策略；寻找品质优异的高成长型上市公司及分红能力强的价值型上市公司，并辅助以国际竞争力比较，寻找具有市场估值合理的股票，确定最终的投资组合。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数
风险收益特征	本基金属于中等风险的混合型基金，其风险收益特征从长期平均来看，介于股票基金与债券基金之间。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	秦一楠
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599

传真	010-68779528	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街69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	北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	400010	100031
法定代表人	张宗友	周慕冰

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	致同会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	324,477,551.73	132,147,420.74	-42,184,358.76
本期利润	626,860,742.78	447,360,460.91	-248,183,066.06

加权平均基金份额本期利润	0.5097	0.3349	-0.1786
本期加权平均净值利润率	47.23%	41.30%	-23.96%
本期基金份额净值增长率	64.14%	54.49%	-22.37%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	326,262,413.37	333,078,383.32	-2,515,822.51
期末可供分配基金份额利润	0.2558	0.2579	-0.0019
期末基金资产净值	1,547,705,322.57	1,236,513,839.10	808,122,751.08
期末基金份额净值	1.2134	0.9574	0.6197
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	1,069.67%	612.65%	362.20%

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
过去三个月	5.58%	1.29%	8.20%	0.60%	-2.62%	0.69%
过去六个月	21.26%	1.46%	15.07%	0.81%	6.19%	0.65%
过去一年	64.14%	1.53%	17.94%	0.86%	46.20%	0.67%
过去三年	96.85%	1.45%	25.06%	0.80%	71.79%	0.65%
过去五年	81.02%	1.25%	34.05%	0.75%	46.97%	0.50%
自基金合同生效起至今	1,069.67%	1.48%	299.31%	1.02%	770.36%	0.46%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数,债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数,复和业绩比较基准为 60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数。

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

新华优选分红混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2005 年 9 月 16 日至 2020 年 12 月 31 日)

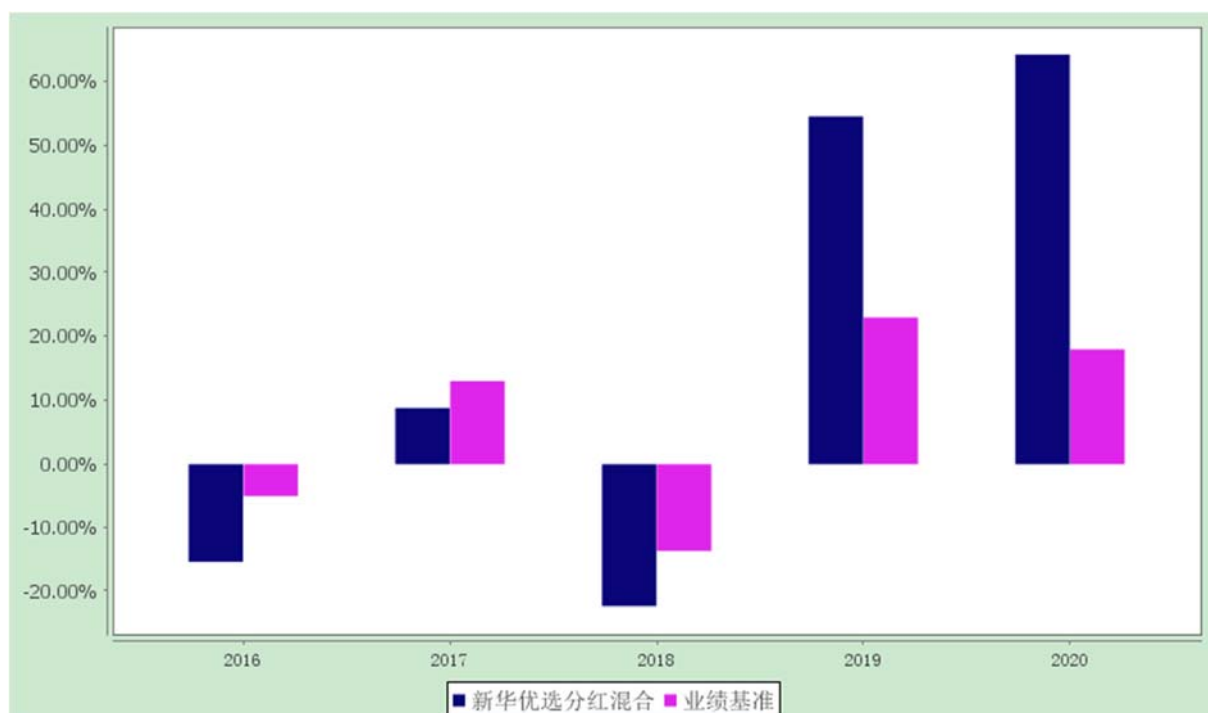


注：本基金于 2005 年 9 月 16 日基金合同生效。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华优选分红混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	2.685	203,398,410.22	109,503,166.67	312,901,576.89	-
合计	2.685	203,398,410.22	109,503,166.67	312,901,576.89	-

§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 12 月 31 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十九只开放式基金，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。

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		
赵强	本基金基金经理，权益投资部总监，新华策略精选股票型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2017-05-17	-	17	管理学硕士，历任国金基金高级研究员、英大基金基金经理、中欧基金投资经理。

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

注：本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华优选分红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》、《新华优选分红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 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，本报告期内，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

2020 年是跌宕起伏，历经波折的一年，年初全世界遭受了史无前例的新冠疫情冲击，重创了全球经济，随后主要国家都采取了严厉的防控措施，疫情有所缓解，疫苗的成功研发让人们看到了彻底战胜疫情的希望和曙光。与此同时，全球资本市场和大宗商品市场都经历了大幅的波动，投资者在极度悲观和乐观之间大幅频繁轮换，黑天鹅事件频发，史上罕见，不断改写金融历史和挑战人们的认知。为了恢复经济，各国都推出了相对宽松的货币政策，流动性总体保持充裕，无风险利率持续下降，对恢复经济和推动股市上涨起到了重要作用。特别是能够抵御经济波动的成长确定的优质龙头白马，成为增量资金主要建仓的对象，投资者要求的长期贴现率大幅下降，估值也得到快速提升，优质龙头公司取得了非常惊人的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.2134 元，本报告期份额净值增长率为 64.14%，同期业绩比较基准的增长率为 17.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年以来，市场波动开始加大，美债利率的快速上行是市场调整幅度较大的关键导火索。2 月初以来，欧美在疫情明显好转、疫苗接种加速、经济超预期修复的同时，政策面依旧较为宽松，这推动市场对于交易复苏达成高度一致的预期，原油和铜铝等大宗商品价格快速上涨，美债十年期利率也快速攀升至 1.5% 左右。对于国内市场来说，复苏交易在助推有色和化工等周期板块在近期较快上涨的同时，也对部分前期高估值板块带来较大的调整压力。随着经济复苏，市场预期流动性将会缓慢收紧，中美的无风险利率都出现了上升，龙头公司的相对稀缺性降低，这都促使无风险利率

和风险溢价出现回升，导致贴现率回升，使得前期高估值的优秀公司，同样也面临价格下降的压力，这就是前期龙头白马公司出现一定瓦解分化的最重要原因。

我们对长期权益市场还是保持积极乐观，特别是在调整之后，还是非常看好高质量白马龙头的投资机会。因为，从长期来看，居民资产再配置向权益资产转移是大势所趋。近些年中国居民的资产配置也遵循了海外发达经济体历史上的走势，在房住不炒的大背景下，不断减配房地产为主的不动产，加配股票，基金等金融资产，因此证券市场会有源源不断的资金来源，权益市场流动性总体充裕，能够抵御部分市场整体流动性减少带来的压力。此外，长期投资回报率下降会使得确定性优质资产更加稀缺。从美国和日本的历史情况不难看出，当净资产收益率或者说投资回报率长期下降时候，长端利率也保持相同走势，也同样趋势性下降。从长期角度来看，中国的投资回报率和国债收益率都难免下行趋势。在整个社会投资回报率下行的趋势下，高质量确定性增长的优质资产价格将被持续推升，稀缺性更加明显，这也是我们持续聚焦优秀企业，特别是高质量行业龙头的本质原因。

因此，在投资策略上，我们会以合理的价格买入优秀的龙头公司，或者估值略高一些也可以适当容忍。因为从长期来看，价格贵一点买入优秀公司，远好于以便宜的价格买入平庸的公司，这已经被无数中外投资案例所验证过。但是对于前期大家追捧的短期估值过贵的公司，即使公司很优秀，我们还是要心存敬畏，暂时保持观望，耐心等待合理的价格水平再考虑介入。因为短期估值上涨过高的本质，就是提升了当前短期的收益率，牺牲了长期的投资回报率。正是因为投资者要求的长期回报率降低，贴现率下降，短期估值才会大幅上涨，因此短期获得了非常好的盈利，既挣到了盈利的钱，又挣到了估值的钱，但是长期却不可持续。投资者不要简单的线性外推，认为当前涨幅很高的优秀公司，以后也会同样不断估值提升，这是不切实际的幻想。反而对于前期市场关注不多的，估值合理的二线龙头和隐形行业的龙头，我们现在则相对乐观，会重点配置。

展望 2021 年，我们认为更多要靠优秀公司，不断创造超预期的业绩来获得回报，来化解流动性带来估值下降的不利影响。这正如逆水行舟，靠优秀的船长和动力强劲的马达，一样可以逆流而上，乘风破浪。在行业方面，我们看好的三个方向都和中国的人口相关，也是中国的比较优势：一是受益于工程师红利的高端制造业，比如机械、电气设备、新能源等；二是受益于中国老龄化的医疗保健行业；三是受益于消费升级的消费行业。除此以外，为了降低组合的波动和分散风险，我们还配置了一些低估值比如建材、地产等行业龙头。

在投资方法上，我们坚持以 ROIC 为锚，精选高质量的优秀公司，长期持有，靠投资优秀的公司给基金持有人赚钱。ROIC（return on invested capital）是指投入资本金回报率，是指税后营业利润（NOPLAT）除以投入资本（包括流动资本与固定资本之和）的比率。ROIC 衡量的是主营业务的

真实投资回报率，并且剔除了资本结构和非经常损益的影响，比 ROE 更加客观真实的衡量投出资金的使用效果，是综合考量企业竞争力的核心指标，是寻找“好的企业、好的生意、好的价格”的重要指标。优秀的公司是“低投入、高产出”，而差的公司则是“高投入、低产出”。只有当回报率高于资金成本时候（ $ROIC > WACC$ ）时，增长才能给企业创造价值；否则的话，增长越快，则越毁灭价值，特别是我们要规避那些主要靠资本投入驱动增长的低盈利公司，这是典型的伪成长公司和投资陷阱。

在选择公司上，我们会坚持用五维度甄选高质量公司：1、高盈利能力 ROIC，这是我们的初心和长期业绩保证；2、现金流好，能够长期给股东创造大量自由现金流；3、优秀的盈利模式，最好是轻资产模式，能够实现较高的内生增长；4、需求长期稳定，并不特别需要爆发增长，在需求波动大或技术迭代快的行业中反而不容易出长期牛股；5、供给壁垒高，竞争格局好，龙头公司具备长期竞争优势。所有这些结果最基本的保障是优秀的管理层、良好的治理结构和市场化的激励机制。

投资是自身不断修炼的过程，是建立在正确的价值观和克服人性缺点的基础之上，有了正确的价值观，就会坚持做正确的事情，不会为短期的诱惑所撼动。要深刻洞察人性，理解人性的弱点，不断战胜人性的缺点，逆人性去投资，放弃捷径，选择艰难但对的事情，终究会达到成功的彼岸。也希望我们的基金持有人能与我们一路同行，选择长期相伴，做时间的朋友，共同实现我们投资的初心！

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定的要求，完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

二、督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

三、根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对

公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

四、在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部对公司员工进行了法律法规的专项培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

通过上述工作，在本报告期内，公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.7.1.1 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。

4.7.1.2 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。

4.7.1.3 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。

4.7.1.4 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。

4.7.1.5 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，3 月 13 日进行了利润分配，每 10 份分配基金红利 0.36 元，共分配红利金额

42,270,206.01 元;5 月 19 日进行了利润分配,每 10 份分配基金红利 0.37 元,共分配红利金额 42,220,731.24 元;6 月 1 日进行了利润分配,每 10 份分配基金红利 0.33 元,共分配红利金额 37,893,540.87 元;6 月 16 日进行了利润分配,每 10 份分配基金红利 0.39 元,共分配红利金额 44,571,696.31 元;6 月 30 日进行了利润分配,每 10 份分配基金红利 0.635 元,共分配红利金额 74,064,675.17 元;7 月 7 日进行了利润分配,每 10 份分配基金红利 0.60 元,共分配红利金额 71,880,727.29 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人-新华基金管理股份有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,新华基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

致同审字（2021）第 110A005981 号

新华优选分红混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了新华优选分红混合型证券投资基金（以下简称“新华优选分红基金”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了新华优选分红混合型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于新华优选分红基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

新华优选分红混合基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括新华优选分红混合基金 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定编制

财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估新华优选分红混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算新华优选分红混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督新华优选分红混合基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据所获取的审计证据，就可能导致对新华优选分红混合基金的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致新华优选分红混合基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

致同会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

范晓红 刘蕾

北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层

2021 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华优选分红混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	51,007,414.10	43,714,726.55
结算备付金		857,124.77	1,496,694.74
存出保证金		544,316.00	542,372.68
交易性金融资产	7.4.7.2	1,448,992,149.06	1,142,520,146.98
其中：股票投资		1,358,950,149.06	1,082,424,146.98
基金投资		-	-
债券投资		90,042,000.00	60,096,000.00
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	7.4.7.3	65,000,000.00	65,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.4	2,189,751.21	1,125,621.89
应收股利		-	-
应收申购款		24,672,211.58	444,073.54
递延所得税资产		-	-

其他资产		-	-
资产总计		1,593,262,966.72	1,254,843,636.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 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		31,885,518.93	7,367,509.12
应付赎回款		8,281,897.46	5,652,167.53
应付管理人报酬		1,912,354.78	1,526,275.38
应付托管费		318,725.81	254,379.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.5	1,522,508.48	1,659,806.15
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,636,638.69	1,869,659.86
负债合计		45,557,644.15	18,329,797.28
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.7	792,913,255.62	802,882,885.97
未分配利润	7.4.7.8	754,792,066.95	433,630,953.13
所有者权益合计		1,547,705,322.57	1,236,513,839.10
负债和所有者权益总计		1,593,262,966.72	1,254,843,636.38

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2134 元，基金份额 1,275,492,399.22 份。

7.2 利润表

会计主体：新华优选分红混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		654,721,048.29	471,485,342.57
1.利息收入		2,422,722.18	2,584,041.08
其中：存款利息收入	7.4.7.9	624,413.63	681,803.21
债券利息收入		1,663,908.42	1,817,042.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		134,400.13	85,195.23
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		349,459,139.49	153,609,752.79
其中：股票投资收益	7.4.7.10	335,563,809.28	134,291,820.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-1,017.22	9,605.40
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	7.4.7.12	13,896,347.43	19,308,327.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	302,383,191.05	315,213,040.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	455,995.57	78,508.53
减：二、费用		27,860,305.51	24,124,881.66
1. 管理人报酬		19,875,937.89	16,189,659.96
2. 托管费		3,312,656.20	2,698,276.69
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.15	4,403,391.14	4,971,679.75

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.21	26.76
7. 其他费用	7.4.7.16	268,320.07	265,238.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		626,860,742.78	447,360,460.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		626,860,742.78	447,360,460.91

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华优选分红混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	802,882,885.97	433,630,953.13	1,236,513,839.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	626,860,742.78	626,860,742.78
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）	-9,969,630.35	7,201,947.93	-2,767,682.42
其中：1.基金申购款	447,212,504.42	344,851,821.33	792,064,325.75
2.基金赎回款	-457,182,134.77	-337,649,873.40	-794,832,008.17
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）	-	-312,901,576.89	-312,901,576.89

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	792,913,255.62	754,792,066.95	1,547,705,322.57
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	810,638,573.59	-2,515,822.51	808,122,751.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	447,360,460.91	447,360,460.91
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)	-7,755,687.62	-11,213,685.27	-18,969,372.89
其中：1.基金申购款	175,160,586.67	51,669,342.73	226,829,929.40
2.基金赎回款	-182,916,274.29	-62,883,028.00	-245,799,302.29
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)	802,882,885.97	433,630,953.13	1,236,513,839.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 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: 翟晨曦, 会计机构负责人: 徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华优选分红混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2005]第 115 号《关于核准新世纪优选分红混合型证券投资基金募集的批复》核准，由新华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新华优选分红混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集资金总额 618,416,866.55 元，业经重庆天健会计师事务所重天健验【2005】第 26 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新华优选分红混合型证券投资基金基金合同》于 2005 年 9 月 16 日正式生效。本基金的基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新华优选分红混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围是：股票投资比例为基金资产净值的 20%--90%；债券及短期金融工具的投资比例为基金资产净值 10%--80%。其中本基金实时持有的现金和到期日在一年以内的政府债券的合计比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数。

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 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 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》、《新华优选分红混合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

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

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

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

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中

的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

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

提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	51,007,414.10	43,714,726.55
定期存款	-	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
存款期限 1 月以内	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	51,007,414.10	43,714,726.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
----	-------------------------

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		871,822,346.39	1,358,950,149.06	487,127,802.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	90,520,590.00	90,042,000.00	-478,590.00
	合计	90,520,590.00	90,042,000.00	-478,590.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		962,342,936.39	1,448,992,149.06	486,649,212.67
项目		上年度末		
		2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		898,198,745.36	1,082,424,146.98	184,225,401.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	60,055,380.00	60,096,000.00	40,620.00
	合计	60,055,380.00	60,096,000.00	40,620.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		958,254,125.36	1,142,520,146.98	184,266,021.62

7.4.7.3 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末	
	2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	65,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	65,000,000.00	-
项目	上年度末	
	2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	65,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	65,000,000.00	-

7.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	12,410.14	20,934.70
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	630.70	917.60
应收债券利息	2,173,213.11	1,099,098.36
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	3,497.26	4,671.23
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	2,189,751.21	1,125,621.89

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

7.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日

交易所市场应付交易费用	1,522,508.48	1,659,506.15
银行间市场应付交易费用	-	300.00
合计	1,522,508.48	1,659,806.15

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	750,000.00
应付赎回费	18,979.09	2,000.26
其他应付款	917,659.60	917,659.60
预提费用	200,000.00	200,000.00
合计	1,636,638.69	1,869,659.86

7.4.7.7 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,291,530,645.73	802,882,885.97
本期申购	719,391,070.75	447,212,504.42
本期赎回（以“-”号填列）	-735,429,317.26	-457,182,134.77
本期末	1,275,492,399.22	792,913,255.62

注：本基金 2008 年 1 月 3 日按照 1:1.608593343 的比例对份额进行了拆分。

7.4.7.8 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	333,078,383.32	100,552,569.81	433,630,953.13
本期利润	324,477,551.73	302,383,191.05	626,860,742.78
本期基金份额交易产生的	-18,391,944.79	25,593,892.72	7,201,947.93

变动数			
其中：基金申购款	145,827,465.42	199,024,355.91	344,851,821.33
基金赎回款	-164,219,410.21	-173,430,463.19	-337,649,873.40
本期已分配利润	-312,901,576.89	-	-312,901,576.89
本期末	326,262,413.37	428,529,653.58	754,792,066.95

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	594,606.40	640,967.13
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	29,807.23	40,836.08
其他	-	-
合计	624,413.63	681,803.21

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,650,830,309.25	1,789,057,395.35
减：卖出股票成本总额	1,315,266,499.97	1,654,765,575.19
买卖股票差价收入	335,563,809.28	134,291,820.16

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,017.22	9,605.40
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-1,017.22	9,605.40

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	61,995,520.50	159,454,633.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	60,406,480.00	156,147,698.05
减：应收利息总额	1,590,057.72	3,297,329.85
买卖债券差价收入	-1,017.22	9,605.40

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	13,896,347.43	19,308,327.23
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	13,896,347.43	19,308,327.23

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	302,383,191.05	315,213,040.17
——股票投资	302,902,401.05	315,174,060.17

——债券投资	-519,210.00	38,980.00
——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	302,383,191.05	315,213,040.17

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	451,374.90	74,910.86
转换费收入	-	-
其他	-	-
基金转换费收入	4,620.67	3,597.67
印花税返还	-	-
合计	455,995.57	78,508.53

7.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	4,402,866.14	4,971,079.75
银行间市场交易费用	525.00	600.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-

合计	4,403,391.14	4,971,679.75
----	--------------	--------------

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
债券账户维护费	36,000.00	36,000.00
汇划手续费	31,120.07	28,038.50
指数使用费	-	-
其他	1,200.00	1,200.00
债券托管帐户维护费	-	-
债券信息维护费	-	-
合计	268,320.07	265,238.50

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截止 2020 年 12 月 31 日,本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

◎ 本基金管理人于 2021 年 1 月 12 日发布分红公告,以 2021 年 1 月 4 日为收益分配基准日,向截至 2021 年 1 月 13 日止本基金登记注册的份额持有人,按每 10 份基金份额分配红利人民币 2.05 元。

◎ 本基金管理人于 2021 年 1 月 21 日发布分红公告,以 2021 年 1 月 13 日为收益分配基准日,向截至 2021 年 1 月 22 日止本基金登记注册的份额持有人,按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.61 元。

◎ 本基金管理人于 2021 年 1 月 28 日发布分红公告,以 2021 年 1 月 22 日为收益分配基准日,向截至 2021 年 1 月 29 日止本基金登记注册的份额持有人,按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.465 元。

7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
北京新华富时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	494,446,669.49	17.08%	213,622,489.58	6.14%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	-	-	5,586,038.00	18.10%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	95,000,000.00	39.92%	50,000,000.00	13.29%

7.4.10.1.5 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12月31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	416,538.36	17.88%	104,574.67	6.87%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	165,037.29	5.98%	12,031.06	0.72%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,875,937.89	16,189,659.96
其中：支付销售机构的客户维护费	3,128,734.31	2,930,652.42

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提确认。计算公式为：

每日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × (1.5% ÷ 当年天数)

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,312,656.20	2,698,276.69

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。计算公式为

每日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × (0.25% ÷ 当年天数)

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用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。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
-------	-----------------------------	----------------------------------

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	51,007,414.10	594,606.40	43,714,726.55	640,967.13

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内与上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2020-03-13	2020-03-16	2020-03-13	0.360	28,828,257.16	13,441,948.85	42,270,206.01	-
2	2020-05-19	2020-05-20	2020-05-19	0.370	28,395,667.27	13,825,063.97	42,220,731.24	-
3	2020-06-01	2020-06-02	2020-06-01	0.330	25,051,270.48	12,842,270.39	37,893,540.87	-
4	2020-06-16	2020-06-17	2020-06-16	0.390	29,058,354.17	15,513,342.14	44,571,696.31	-
5	2020-06-30	2020-07-01	2020-06-30	0.635	47,323,688.90	26,740,986.27	74,064,675.17	-
6	2020-07-07	2020-07-08	2020-07-07	0.600	44,741,172.24	27,139,555.05	71,880,727.29	-
合计				2.685	203,398,410.22	109,503,166.67	312,901,576.89	-

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
300385	雪浪环境	2017-12-13	2021-12-14	非公开发行	11.56	6.77	389,189.00	4,499,999.20	2,634,809.53	-
601995	中金公司	2020-10-22	2021-05-06	新股锁定期内	28.78	68.71	24,951.00	718,089.78	1,714,383.21	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新股锁定期内	25.70	88.29	8,495.00	218,321.50	750,023.55	-
688339	亿华通	2020-07-31	2021-02-10	新股锁定期内	76.65	257.95	2,761.00	211,630.65	712,199.95	-
688390	固德威	2020-08-27	2021-03-04	新股锁定期内	37.93	221.72	2,585.00	98,049.05	573,146.20	-
688658	悦康药业	2020-12-16	2021-06-24	新股锁定期内	24.36	22.31	16,580.00	403,888.80	369,899.80	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	新股锁定期内	118.27	603.36	473.00	55,941.71	285,389.28	-
688488	艾迪药业	2020-07-09	2021-01-20	新股锁定期内	13.99	24.48	9,934.00	138,976.66	243,184.32	-
300862	蓝盾光电	2020-08-07	2021-02-24	新股锁定期内	33.95	38.54	5,843.00	198,369.85	225,189.22	-
688127	蓝特光学	2020-09-14	2021-03-22	新股锁定期内	15.41	33.60	5,322.00	82,012.02	178,819.20	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新股锁定期内	138.02	126.67	381.00	52,585.62	48,261.27	-
300867	圣元环保	2020-08-12	2021-03-03	新股锁定期内	19.34	31.97	1,498.00	28,971.32	47,891.06	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	网下中签	10.76	10.76	3,225.00	34,701.00	34,701.00	-

300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定期内	10.76	10.76	359.00	3,862.84	3,862.84	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新股锁定期内	24.60	61.51	610.00	15,006.00	37,521.10	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	新股锁定期内	21.34	37.84	871.00	18,587.14	32,958.64	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	网下中签	13.39	13.39	1,946.00	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定期内	13.39	13.39	217.00	2,905.63	2,905.63	-
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	新股锁定期内	33.61	38.70	618.00	20,770.98	23,916.60	-
300894	火星	2020-12-24	2021-07-01	新股锁定期内	14.07	36.97	628.00	8,835.96	23,217.16	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	新股锁定期内	30.26	47.87	474.00	14,343.24	22,690.38	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	新股锁定期内	39.74	60.44	285.00	11,325.90	17,225.40	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新股锁定期内	10.78	33.03	496.00	5,346.88	16,382.88	-
300913	兆龙互连	2020-11-27	2021-06-07	新股锁定期内	13.21	23.94	630.00	8,322.30	15,082.20	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新股锁定期内	71.71	90.85	166.00	11,903.86	15,081.10	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	新股锁定期内	20.08	37.33	353.00	7,088.24	13,177.49	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新股锁定期内	12.65	45.30	283.00	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	新股锁定期内	20.09	36.62	350.00	7,031.50	12,817.00	-

300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	新股锁定期内	10.33	25.79	440.00	4,545.20	11,347.60	-
300911	亿田智能	2020-11-24	2021-06-03	新股锁定期内	24.35	33.06	309.00	7,524.15	10,215.54	-
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	新股锁定期内	4.97	8.94	1,063.00	5,283.11	9,503.22	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	新股锁定期内	14.17	32.31	291.00	4,123.47	9,402.21	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	新股锁定期内	16.05	31.58	287.00	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	新股锁定期内	18.78	31.94	281.00	5,277.18	8,975.14	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	网下中签	16.95	16.95	507.00	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	网下中签	15.18	15.18	480.00	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	新股锁定期内	18.59	45.67	147.00	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	网下中签	15.27	15.27	387.00	5,909.49	5,909.49	-

注：本报告期末本基金未持有流通受限的债券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年末 2019年12月31日
A-1	0.00	-
A-1 以下	0.00	-
未评级	90,042,000.00	60,096,000.00
合计	90,042,000.00	60,096,000.00

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

7.4.13.2.4 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投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	51,007,414.10	-	-	-	51,007,414.10
结算备付金	857,124.77	-	-	-	857,124.77
存出保证金	544,316.00	-	-	-	544,316.00
交易性金融资产	90,042,000.00	-	-	1,358,950,149.06	1,448,992,149.06
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	65,000,000.00	-	-	-	65,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,189,751.21	2,189,751.21
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	24,672,211.58	24,672,211.58
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	207,450,854.87	-	-	1,385,812,111.85	1,593,262,966.72
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	-	-	-	31,885,518.93	31,885,518.93
应付赎回款	-	-	-	8,281,897.46	8,281,897.46
应付管理人报酬	-	-	-	1,912,354.78	1,912,354.78
应付托管费	-	-	-	318,725.81	318,725.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,522,508.48	1,522,508.48
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,636,638.69	1,636,638.69
负债总计	-	-	-	45,557,644.15	45,557,644.15
利率敏感度缺口	207,450,854.87	-	-	1,340,254,467.70	1,547,705,322.57
上年度末 2019 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	43,714,726.55	-	-	-	43,714,726.55
结算备付金	1,496,694.74	-	-	-	1,496,694.74
存出保证金	542,372.68	-	-	-	542,372.68
交易性金融资产	60,096,000.00	-	-	1,082,424,146.98	1,142,520,146.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	65,000,000.00	-	-	-	65,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,125,621.89	1,125,621.89
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	444,073.54	444,073.54
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	170,849,793.97	-	-	1,083,993,842.41	1,254,843,636.38
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	-	-	-	7,367,509.12	7,367,509.12
应付赎回款	-	-	-	5,652,167.53	5,652,167.53
应付管理人报酬	-	-	-	1,526,275.38	1,526,275.38
应付托管费	-	-	-	254,379.24	254,379.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,659,806.15	1,659,806.15
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,869,659.86	1,869,659.86
负债总计	-	-	-	18,329,797.28	18,329,797.28
利率敏感度缺口	170,849,793.97	-	-	1,065,664,045.13	1,236,513,839.10

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	减少约 16,987.18	减少约 47,306.41
	市场利率下降 25.00 bp	增加约 16,996.33	增加约 47,379.67

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	1,358,950,149.06	87.80	1,082,424,146.98	87.54
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	90,042,000.00	5.82	60,096,000.00	4.86
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	1,448,992,149.06	93.62	1,142,520,146.98	92.40

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	增加约 15,171,041.48	增加约 10,057,005.32
	沪深 300 指数下降 1%	减少约 15,171,041.48	减少约 10,057,005.32

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,358,950,149.06	85.29
	其中：股票	1,358,950,149.06	85.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	90,042,000.00	5.65
	其中：债券	90,042,000.00	5.65
	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	65,000,000.00	4.08
	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	51,864,538.87	3.26
8	其他各项资产	27,406,278.79	1.72
9	合计	1,593,262,966.72	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,253,213,373.55	80.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,278,348.73	1.12
J	金融业	1,714,383.21	0.11
K	房地产业	56,728,975.14	3.67
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,072,636.00	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	8,094,972.16	0.52
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	7,847,460.27	0.51
S	综合	-	-
	合计	1,358,950,149.06	87.80

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有沪港通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601100	恒立液压	1,100,000	124,300,000.00	8.03
2	603338	浙江鼎力	1,100,000	111,309,000.00	7.19
3	300639	凯普生物	2,400,500	90,210,790.00	5.83
4	000333	美的集团	850,000	83,674,000.00	5.41
5	600690	海尔智家	2,610,000	76,238,100.00	4.93
6	688139	海尔生物	1,136,395	74,195,229.55	4.79
7	300285	国瓷材料	1,480,731	66,795,775.41	4.32
8	603583	捷昌驱动	824,900	63,723,525.00	4.12
9	000656	金科股份	8,000,000	56,720,000.00	3.66
10	603489	八方股份	285,000	54,235,500.00	3.50
11	300482	万孚生物	605,984	54,059,832.64	3.49
12	600585	海螺水泥	1,040,000	53,684,800.00	3.47
13	300206	理邦仪器	2,800,000	51,100,000.00	3.30
14	002706	良信股份	1,400,032	42,896,980.48	2.77
15	600305	恒顺醋业	1,700,000	37,638,000.00	2.43
16	002901	大博医疗	501,757	36,994,543.61	2.39
17	002833	弘亚数控	712,360	31,037,525.20	2.01
18	603027	千禾味业	820,000	30,651,600.00	1.98
19	300685	艾德生物	379,400	29,688,050.00	1.92
20	002884	凌霄泵业	1,204,000	28,775,600.00	1.86
21	002242	九阳股份	732,300	23,462,892.00	1.52
22	300725	药石科技	100,000	13,800,000.00	0.89
23	688169	石头科技	13,000	13,468,000.00	0.87
24	002677	浙江美大	600,000	9,558,000.00	0.62
25	300379	东方通	200,079	9,143,610.30	0.59
26	002832	比音勒芬	500,000	8,120,000.00	0.52
27	002803	吉宏股份	249,909	8,057,066.16	0.52
28	300816	艾可蓝	100,000	8,032,000.00	0.52
29	601799	星宇股份	40,000	8,020,000.00	0.52
30	300788	中信出版	183,900	7,799,199.00	0.50
31	603949	雪龙集团	500,000	7,565,000.00	0.49
32	600031	三一重工	200,000	6,996,000.00	0.45
33	603218	日月股份	200,000	6,050,000.00	0.39
34	300759	康龙化成	50,000	6,020,000.00	0.39
35	603915	国茂股份	200,000	5,316,000.00	0.34
36	603127	昭衍新药	47,600	4,908,036.00	0.32
37	688356	键凯科技	30,000	3,294,600.00	0.21
38	688202	美迪西	20,000	3,144,600.00	0.20

39	300385	雪浪环境	389,189	2,634,809.53	0.17
40	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.11
41	300999	金龙鱼	8,495	750,023.55	0.05
42	688339	亿华通	2,761	712,199.95	0.05
43	688390	固德威	2,585	573,146.20	0.04
44	688658	悦康药业	16,580	369,899.80	0.02
45	300896	爱美客	473	285,389.28	0.02
46	688488	艾迪药业	9,934	243,184.32	0.02
47	300862	蓝盾光电	5,843	225,189.22	0.01
48	688127	蓝特光学	5,322	178,819.20	0.01
49	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
50	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
51	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
52	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
53	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
54	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
55	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00
56	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
57	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
58	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
59	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
60	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
61	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
62	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
63	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
64	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.00
65	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
66	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
67	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
68	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
69	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
70	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
71	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
72	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
73	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
74	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
75	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
76	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
77	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
78	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
79	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300639	凯普生物	78,503,586.60	6.35
2	688139	海尔生物	76,372,859.54	6.18
3	002706	良信股份	40,204,264.54	3.25
4	300206	理邦仪器	39,919,087.27	3.23
5	002007	华兰生物	37,764,240.30	3.05
6	603583	捷昌驱动	36,311,012.10	2.94
7	603489	八方股份	36,223,303.00	2.93
8	300482	万孚生物	36,052,566.10	2.92
9	002884	凌霄泵业	28,476,192.52	2.30
10	688006	杭可科技	26,218,512.88	2.12
11	002833	弘亚数控	25,559,300.00	2.07
12	000799	酒鬼酒	23,770,613.85	1.92
13	300326	凯利泰	22,324,770.46	1.81
14	603387	基蛋生物	20,937,160.60	1.69
15	300776	帝尔激光	17,888,471.00	1.45
16	000656	金科股份	16,151,284.00	1.31
17	300294	博雅生物	15,702,142.00	1.27
18	000860	顺鑫农业	15,091,100.00	1.22
19	300759	康龙化成	14,866,387.20	1.20
20	688202	美迪西	14,634,561.98	1.18

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603338	浙江鼎力	78,638,515.17	6.36
2	600048	保利地产	66,804,613.34	5.40
3	601100	恒立液压	65,046,927.70	5.26
4	688006	杭可科技	63,910,733.81	5.17
5	000002	万科A	52,100,600.22	4.21

6	002372	伟星新材	49,172,934.56	3.98
7	300326	凯利泰	47,130,237.05	3.81
8	002007	华兰生物	45,991,995.18	3.72
9	000799	酒鬼酒	39,369,110.32	3.18
10	600383	金地集团	36,788,188.76	2.98
11	688981	中芯国际	30,376,463.14	2.46
12	603713	密尔克卫	29,137,206.00	2.36
13	000568	泸州老窖	23,683,604.99	1.92
14	300450	先导智能	23,062,961.53	1.87
15	603369	今世缘	21,944,411.54	1.77
16	603583	捷昌驱动	19,520,201.69	1.58
17	601658	邮储银行	19,377,068.94	1.57
18	000786	北新建材	19,105,844.00	1.55
19	603387	基蛋生物	19,095,232.24	1.54
20	603489	八方股份	18,547,790.00	1.50

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,294,293,240.20
卖出股票的收入（成交）总额	1,650,830,309.25

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,042,000.00	5.82
	其中：政策性金融债	90,042,000.00	5.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	90,042,000.00	5.82

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	200201	20 国开 01	600,000	60,006,000.00	3.88
2	160302	16 进出 02	300,000	30,036,000.00	1.94

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同尚无股指期货投资政策。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金合同尚无国债期货投资政策。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	544,316.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,189,751.21
5	应收申购款	24,672,211.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,406,278.79

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

8.13.6 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,分项之和与合计之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
43,074	29,611.65	443,647,188.55	34.78%	831,845,210.67	65.22%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	1,080,839.26	0.08%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
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、基金投资和部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 50~100 万份；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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005 年 9 月 16 日)基金份额总额	618,818,129.03
--------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	1,291,530,645.73
本报告期基金总申购份额	719,391,070.75
减：本报告期基金总赎回份额	735,429,317.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,275,492,399.22

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2020 年 6 月 5 日，崔建波先生、晏益民先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理职务。

2020 年 9 月 14 日，刘征宇先生、申峰旗先生担任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理职务。

2020 年 11 月 30 日，刘全胜先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司总经理职务，翟晨曦女士担任总经理（代行）职务。

2020 年 8 月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 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。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

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），报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。审计年限为 1 年。自 2020 年，致同会计师事务所为本基金连续提供 1 年审计服务。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人报告期由于内部控制制度不完善，现有制度未得到有效执行，收到重庆证监局出

具的责令改正并暂停相关业务的行政监管措施，对相关责任人采取出具警示函的行政监管措施，对分管高管采取认定为不适当人选措施的决定，目前公司正在整改进行中。

本基金管理人报告期由于基金收益分配流程控制不严格，收到重庆监管局采取出具警示函的行政监管措施。

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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	494,446,669.49	17.08%	416,538.36	17.88%	-
国盛证券	2	395,074,785.17	13.64%	288,921.65	12.40%	-
西藏东方财富证券	2	276,513,992.93	9.55%	202,215.52	8.68%	-
中泰证券	2	252,058,360.21	8.71%	206,254.69	8.85%	-
华西证券	1	234,602,377.20	8.10%	218,486.80	9.38%	-
东吴证券	1	232,889,840.15	8.04%	170,312.64	7.31%	-
信达证券	1	177,963,824.13	6.15%	130,145.74	5.59%	-
国泰君安	1	146,598,512.62	5.06%	136,528.13	5.86%	-
浙商证券	1	132,874,575.09	4.59%	97,171.51	4.17%	-
兴业证券	1	100,697,156.84	3.48%	93,779.86	4.02%	-
东兴证券	2	89,682,487.70	3.10%	65,584.34	2.81%	-
银河证券	1	83,557,608.51	2.89%	61,099.84	2.62%	-
中金公司	1	77,562,117.20	2.68%	72,231.95	3.10%	-
中银国际	2	49,424,650.22	1.71%	36,144.49	1.55%	-
中信证券	2	46,380,413.14	1.60%	43,193.82	1.85%	-

光大证券	1	36,691,579.43	1.27%	34,171.25	1.47%	-
招商证券	1	23,464,584.73	0.81%	21,852.92	0.94%	-
华泰证券	1	21,472,743.74	0.74%	15,703.04	0.67%	-
国金证券	1	12,261,898.58	0.42%	11,419.11	0.49%	-
中信建投	1	9,400,764.00	0.32%	6,874.88	0.30%	-
民生证券	2	1,809,452.38	0.06%	1,323.24	0.06%	-
新时代证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用43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。

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	95,000,000.00	39.92%	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	118,000,000.00	49.58%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	405,520.50	100.00%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	20,000,000.00	8.40%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	5,000,000.00	2.10%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-

11.9 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、电子信息披露网站	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、电子信息披露网站	2020-01-10
3	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、电子信息披露网站	2020-01-20
4	新华优选分红混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	公司网站、电子信息披露网站	2020-01-20
5	新华优选分红混合型证券投资基金基金分红公告	中国证券报、公司网站、电子信息披露网站	2020-03-12
6	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、电子信息披露网站	2020-03-26
7	新华优选分红混合型证券投资基金 2019 年年度报告	公司网站、电子信息披露网站	2020-03-26
8	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、电子信息披露网站	2020-03-27
9	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、电子信息披露网站	2020-04-08
10	新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加广发证券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、电子信息披露网站	2020-04-10
11	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、电子信息披露网站	2020-04-21
12	新华优选分红混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	公司网站、电子信息披露网站	2020-04-21
13	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、电子信息披露网站	2020-04-30

14	新华优选分红混合型证券投资基金基金分红公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-05-15
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	新华优选分红混合型证券投资基金基金分红公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-05-28
17	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
18	新华优选分红混合型证券投资基金基金分红公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-06-12
19	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
20	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
21	新华优选分红混合型证券投资基金基金分红公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-06-24
22	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
23	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年第 2 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	2020-07-17
24	新华优选分红混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-07-17
25	新华基金管理股份有限公司关于新华优选分红混合型证券投资基金在上海浦东发展银行股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-07-25
26	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	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	2020-07-31
27	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理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	2020-07-31
28	新华基金管理股份有限公司关于暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日	2020-08-14

	关销售业务的公告	报、公司网站、电子信 披网站	
29	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧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	2020-08-03
30	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年中期报告提示性公告	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	2020-08-27
31	新华优选分红混合型证券投资基金 2020 年中期报告	公司网站、电子信披网 站	2020-08-27
32	新华优选分红混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证券报、公司网站、 电子信披网站	2020-08-28
33	新华基金管理股份有限公司关于降低旗下部分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	2020-09-16
34	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	证券日报、公司网站、 电子信披网站	2020-09-16
35	新华基金管理股份有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、公司网站、 电子信披网站	2020-09-18
36	新华优选分红混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	公司网站、电子信披网 站	2020-10-27
37	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年第 3 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	2020-10-27
38	新华优选分红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	2020-10-31
39	新华优选分红混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证券报、公司网站、 电子信披网站	2020-10-31
40	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信 披网站	2020-11-17
41	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	证券日报、公司网站、 电子信披网站	2020-12-01
42	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金增加天风证券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	2020-12-15
43	新华基金管理股份有限公司关于直销农行网银支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日	2020-12-17

		报、公司网站、电子信 披网站	
44	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基金申购及定期定额投资手续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	2020-12-25
45	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分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	2020-12-25
46	新华基金管理股份有限公司新华优选分红混合型证券投资基金增加长江证券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、公司网站、电子信披网站	2020-12-25
47	关于新华优选分红混合型证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-12-31

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准新世纪优选分红混合型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新世纪优选分红混合型证券投资基金之法律意见书
- (三)中国证监会关于核准新世纪基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (四)新华优选分红混合型证券投资基金基金合同
- (五)新华优选分红混合型证券投资基金托管协议
- (六)新华优选分红混合型证券投资基金登记结算服务协议
- (七)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (八)更新的《新华优选分红混合型证券投资基金招募说明书》
- (九)《新华优选分红混合型证券投资基金基金产品资料概要》（更新）
- (十)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程
- (十一)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (十二)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

(十三)中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 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

二〇二一年三月三十日