
新华中证环保产业指数证券投资基金
(新华中证环保产业指数分级证券投资基金)

2020 年第 4 季度报告

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

自2020年12月3日，原新华中证环保产业指数分级证券投资基金名称变更为新华中证环保产业指数证券投资基金。原新华中证环保产业指数分级证券投资基金报告期自2020年10月1日至2020年12月2日止，新华中证环保产业指数证券投资基金报告期自2020年12月3日至2020年12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 新华中证环保产业指数证券投资基金

基金简称	新华中证环保产业指数
场内简称	新华环保
基金主代码	164304
交易代码	164304
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月3日
报告期末基金份额总额	84,758,722.88份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金按照成份股在中证环保产业指数中的基准权重构

	建指数化投资组合，原则上采用完全复制法，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对实际投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	95%×中证环保产业指数收益率 +5%×商业银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金是指数型基金，具有较高预期收益、较高预期风险的特征。预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
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

2.2 新华中证环保产业指数分级证券投资基金

基金简称	新华中证环保产业指数分级
场内简称	新华环保
基金主代码	164304
交易代码	164304
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月11日
报告期末基金份额总额	71,979,706.89份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资程序约束和量化风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证环保产业指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对实际投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

业绩比较基准	95%×中证环保产业指数收益率 +5%×商业银行活期存款利率（税后）。		
风险收益特征	<p>本基金是指数型基金，具有较高预期收益、较高预期风险的特征。预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。</p> <p>从本基金的基金份额来看，新华环保A份额为稳健收益类份额，具有低预期风险且预期收益相对较低的特征；新华环保B份额为积极收益类份额，具有高预期风险且预期收益相对较高的特征。</p>		
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		
下属分级基金的基金简称	新华环保 A	新华环保 B	新华环保
下属分级基金的场内简称	NCF 环保 A	NCF 环保 B	新华环保
下属分级基金的交易代码	150190	150191	164304
报告期末下属分级基金的份额总额	0.00 份	0.00 份	71,979,706.89 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020年12月3日-2020年 12月31日)	报告期 (2020年10月1日-2020年 12月2日)
1.本期已实现收益	3,303,416.54	2,207,952.90
2.本期利润	10,195,076.95	6,033,188.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.1390	0.0711
4.期末基金资产净值	96,119,887.80	71,669,407.19
5.期末基金份额净值	1.134	0.996

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 新华中证环保产业指数证券投资基金

(报告期: 2020年12月3日-2020年12月31日)

3.2.1.1 本报告期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	净值增长率①	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 (2020年12月3日至 2020年12月31日)	13.86%	2.03%	14.74%	2.04%	-0.88%	-0.01%
自基金合同生效起至今	13.86%	2.03%	14.74%	2.04%	-0.88%	-0.01%

3.2.1.2 自基金转型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

新华中证环保产业指数证券投资基金
 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
 (2020年12月3日-2020年12月31日)



注: 1、本基金转换基准日为2020年12月1日,在份额转换基准日日终,以份额转换后1.000元的基金份额净值为基准,根据新华环保A份额和新华环保B份额的转换比例对转换基准日登记在册的基金份额实施转换。自2020年12月3日起,本基金的基金名称变更为“新华

中证环保产业指数证券投资基金”。

2、报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

3.2.2 新华中证环保产业指数分级证券投资基金

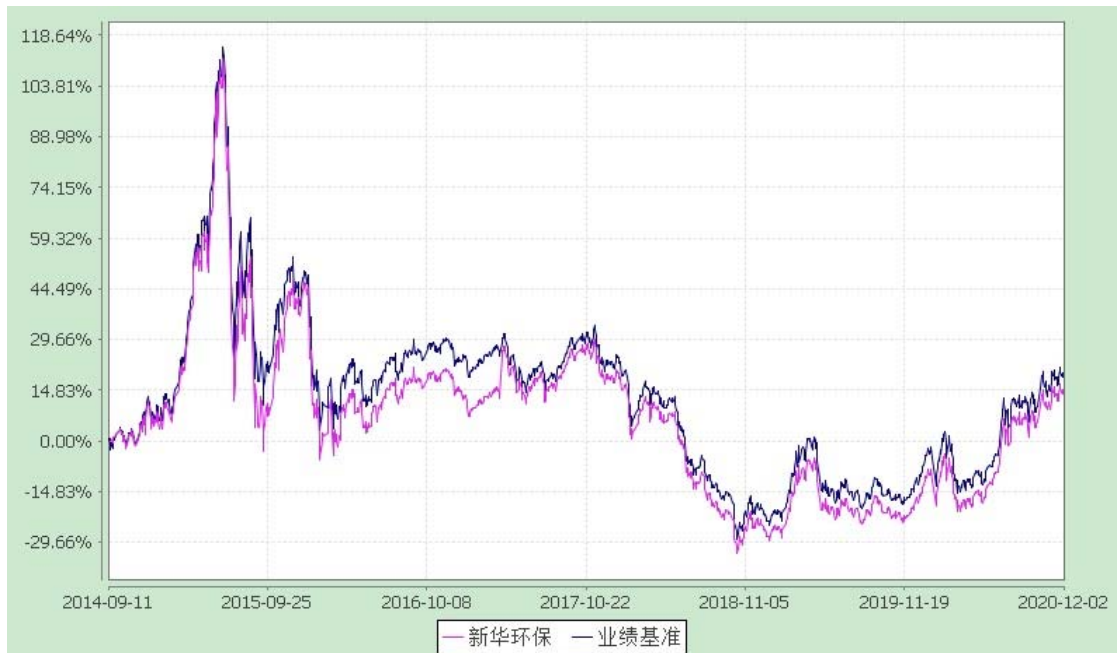
(报告期：2020年10月1日-2020年12月2日)

3.2.2.2 本报告期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	净值增长率①	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 (2020年10月1日至 2020年12月2日)	8.48%	1.42%	8.28%	1.51%	0.20%	-0.09%
过去六个月 (2020年7月1日至2020 年12月2日)	24.85%	1.58%	23.16%	1.61%	1.69%	-0.03%
过去一年 (2020年1月1日至2020 年12月2日)	34.78%	1.70%	31.41%	1.71%	3.37%	-0.01%
过去三年 (2018年1月1日至2020 年12月2日)	-3.00%	1.50%	-2.31%	1.50%	-0.69%	0.00%
过去五年 (2016年1月1日至2020 年12月2日)	-20.22%	1.49%	-18.87%	1.47%	-1.35%	0.02%
自基金合同 生效起至今	14.33%	1.83%	19.26%	1.73%	-4.93%	0.10%

3.2.2.2 自基金合同生效日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

新华中证环保产业指数分级证券投资基金
 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
 (2014年9月11日-2020年12月2日)



注：报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓岳	本基金基金经理，新华MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金基金经理、新华MSCI中国A股国际交易型	2017-08-07	-	12	信息与信号处理专业硕士，历任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员，国信证券股份有限公司量化研究员，光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理，盈融达投资（北京）有限公司投资经理。

	开放式 指数证 券投资 基金联 接基金 基金经 理、新 华沪深 300指 数增强 型证券 投资基 金基金 经理。				
--	---	--	--	--	--

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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证环保产业指数证券投资基金/新华中证环保产业指数分级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》、《新华中证环保产业指数证券投资基金基金合同》、《新华中证环保产业指数分级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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

场外交易中，对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易，交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议，由交易部报投资总监、督察长和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易

部向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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段时间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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数基金，以对标的指数的有效跟踪为投资目标。

2020 年四季度，本基金采用完全复制的被动式指数投资方法，避免不必要的交易，产品紧密跟踪了指数的走势，保持了较小的跟踪误差。报告期内，标的指数发生一次成分股调整，本基金根据成份股及其权重的变动，在有效地控制了跟踪误差的情况下，平稳地完成了调整。

根据证监会对分级基金整改的要求，在本报告期内，本基金从股票指数型分级基金转型为相同标的指数的普通指数基金，仅去除了 AB 份额，转型后的指数基金与原母基金的性质保持一致。

本基金跟踪的标的指数为中证环保产业指数，在 2020 年 12 月 14 日起更改指数编制细则，由等权指数变更为自由流通市值加权指数，且对环保类成分股的界定规则也进行了调整。变更过后，中证环保产业指数中锂电池、光伏、风电、核电等新能源相关成分股所占权重大幅提高，指数的新能源属性占主导地位。

未来本基金将延续完全复制的被动投资策略，紧跟标的指数，争取维持与指数较小的偏离度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前，截至 2020 年 12 月 2 日，本基金份额净值为 0.996 元，2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 2 日份额净值增长率为 8.48%，同期比较基准的增长率为 8.28%。

转型后，截至 2020 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.134 元，2020 年 12 月 3 日至 2020 年 12 月 31 日份额净值增长率为 13.86%，同期比较基准的增长率为 14.74%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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的情形。

§5 投资组合报告

5.1 新华中证环保产业指数证券投资基金

(报告期: 2020年12月3日-2020年12月31日)

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	91,384,285.20	91.14
	其中: 股票	91,384,285.20	91.14
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,180,989.98	8.16
7	其他各项资产	700,148.71	0.70
8	合计	100,265,423.89	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	69,820,008.27	72.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,633,590.32	17.31
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,713,330.61	4.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	217,356.00	0.23
	合计	91,384,285.20	95.07

5.1.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资。

5.1.3 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

5.1.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	29,800	10,463,078.00	10.89
2	601012	隆基股份	108,774	10,028,962.80	10.43
3	600900	长江电力	393,942	7,547,928.72	7.85

4	600438	通威股份	122,800	4,720,432.00	4.91
5	300014	亿纬锂能	51,499	4,197,168.50	4.37
6	300274	阳光电源	46,362	3,351,045.36	3.49
7	002812	恩捷股份	19,910	2,822,839.80	2.94
8	300450	先导智能	28,500	2,393,715.00	2.49
9	002129	中环股份	82,700	2,108,850.00	2.19
10	002074	国轩高科	46,500	1,819,080.00	1.89

5.1.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

报告期末，本基金未持有积极投资。

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

5.1.5 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债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

5.1.7 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。

5.1.8 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权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.1.9.2 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。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

5.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

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

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,323.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	655.42
5	应收申购款	690,169.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	700,148.71

5.1.11.4 报告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。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.1.11.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.1.11.7 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。

5.2 新华中证环保产业指数分级证券投资基金

(报告期: 2020年10月1日-2020年12月2日)

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	67,953,195.97	94.17
	其中：股票	67,953,195.97	94.17
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,186,148.79	5.80
7	其他各项资产	22,115.08	0.03
8	合计	72,161,459.84	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	48,147,768.46	67.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,755,824.03	13.61
E	建筑业	1,221,271.00	1.70
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	2,146,956.72	3.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,175,233.76	8.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	506,142.00	0.71
	合计	67,953,195.97	94.81

5.2.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资。

5.2.3 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

5.2.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300274	阳光电源	42,462	2,009,726.46	2.80
2	002459	晶澳科技	40,200	1,324,590.00	1.85
3	002709	天赐材料	17,280	1,286,668.80	1.80
4	601865	福莱特	35,700	1,243,074.00	1.73
5	601012	隆基股份	15,896	1,108,269.12	1.55
6	600438	通威股份	34,500	1,052,250.00	1.47
7	300751	迈为股份	2,100	1,011,906.00	1.41
8	300037	新宙邦	11,500	981,870.00	1.37
9	601615	明阳智能	56,100	972,774.00	1.36
10	300376	易事特	103,800	970,530.00	1.35

5.2.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

报告期末，本基金未持有积极投资。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

5.2.5 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债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

5.2.7 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。

5.2.8 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权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.2.9.2 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。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 本期国债期货投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.2.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

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

5.2.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,323.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,791.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,115.08

5.2.11.4报告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。

5.2.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.2.11.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.2.11.7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。

§6 开放式基金份额变动

6.1 新华中证环保产业指数证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	71,979,706.89
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	27,102,256.66
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	14,323,240.67

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	84,758,722.88

6.2 新华中证环保产业指数分级证券投资基金

单位：份

项目	新华环保A	新华环保B	新华环保
本报告期期初基金份额总额	5,722,031.00	5,722,031.00	60,534,691.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	95,260,489.19
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	99,318,415.35
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-5,722,031.00	-5,722,031.00	15,502,941.90
本报告期期末基金份额总额	0.00	0.00	71,979,706.89

注：拆分变动份额包括三类份额之间的配对转换份额、定期折算和不定期折算调整份额。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 新华中证环保产业指数证券投资基金

7.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期本基金无单一投资者份额比例达到或超过20%的情况。

7.2 新华中证环保产业指数分级证券投资基金

7.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
	1	20201020-20201028	0.00	49,018,627.45	49,018,627.45	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

7.3 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金于2020年10月23日至10月28日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，表决通过持有人大会决议，自2020年12月3日起原新华中证环保产业指数分级证券投资基金更名为新华中证环保产业指数证券投资基金，同时更改基金合同、招募说明书等文件。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华中证环保产业指数分级证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华中证环保产业指数分级证券投资基金之法律意见书
- (三) 《新华中证环保产业指数证券投资基金托管协议》

-
- (四)《新华中证环保产业指数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《新华中证环保产业指数证券投资基金招募说明书》
 - (七)《新华中证环保产业指数证券投资基金产品资料概要》(更新)
 - (八)关于以通讯方式召开新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告
 - (九) 新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告
 - (十) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
 - (十一) 基金托管人业务资格批件及营业执照
 - (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

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

8.3 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

二〇二一年一月二十一日