

新华策略精选股票型证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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的真实、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）	14
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	33
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	40
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	41
10 重大事件揭示	41
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	45
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	新华策略精选股票型证券投资基金
基金简称	新华策略精选股票
基金主代码	001040
交易代码	001040
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 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
报告期末基金份额总额	304,853,188.03 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握整体市场和行业中的机会，精选投资策略，寻找具有行业增长潜力和价值低估的优质上市公司进行投资，在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续、稳定增长。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券类资产在给定区间内的动态配置。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金采用自上而下与自下而上相结合的主动投资策略，深入分析并积极跟踪驱动股票市场、行业板块、公司股价形成上升趋势的根本性因素，通过前瞻性地把握市场中存在的趋势机会，入手选择具有长期可持续成长能力的股票。</p>
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率 +20%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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	贺倩
	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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	76,619,857.43
本期利润	158,298,215.32
加权平均基金份额本期利润	0.4824
本期加权平均净值利润率	33.52%
本期基金份额净值增长率	39.13%
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	133,032,522.94
期末可供分配基金份额利润	0.4364
期末基金资产净值	565,739,022.14
期末基金份额净值	1.856
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	85.60%

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	16.29%	1.05%	6.08%	0.72%	10.21%	0.33%
过去三个月	41.36%	1.16%	10.42%	0.72%	30.94%	0.44%
过去六个月	39.13%	1.70%	2.13%	1.21%	37.00%	0.49%
过去一年	64.69%	1.35%	8.44%	0.97%	56.25%	0.38%
过去三年	90.16%	1.45%	14.67%	1.00%	75.49%	0.45%
自基金合同生效起至今	85.60%	1.67%	8.42%	1.22%	77.18%	0.45%

注：1、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

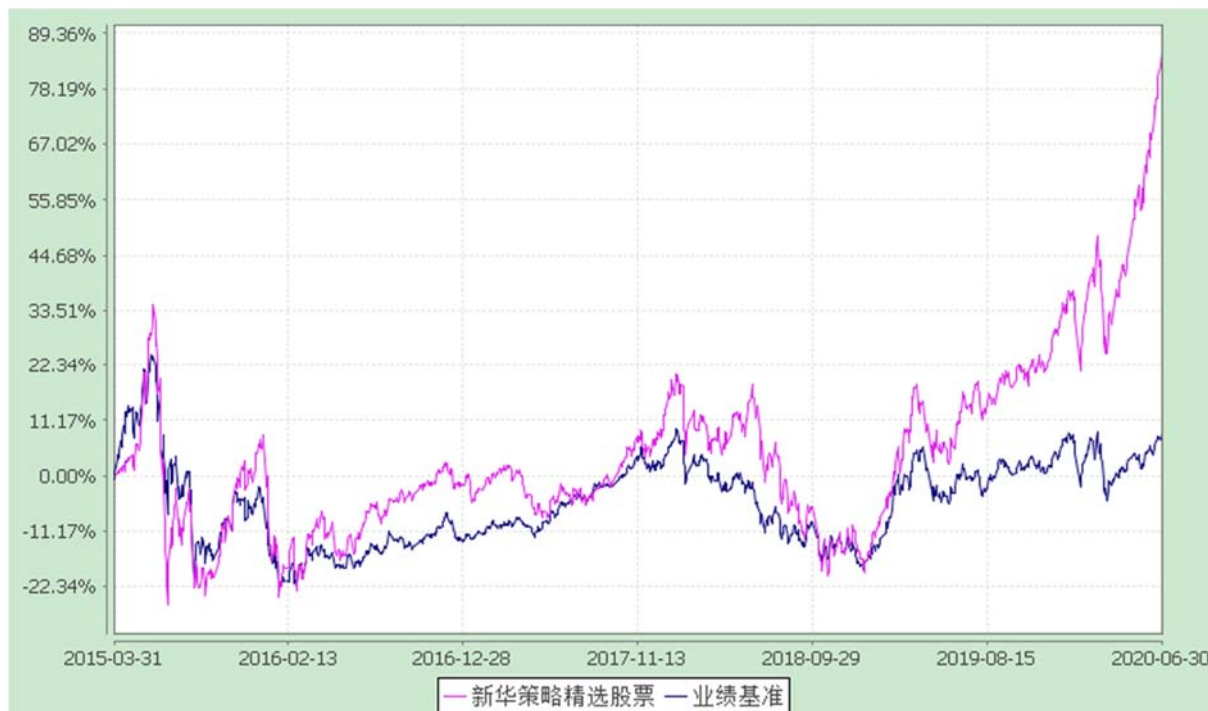
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华策略精选股票型证券投资基金

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

（2015 年 3 月 31 日至 2020 年 6 月 30 日）



注：本基金合同于 2015 年 3 月 31 日生效。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		
赵强	本基金基金经理，权益投资部总监，新华优选分红混合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

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策略精选股票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》、《新华策略精选股票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《证券投资基金管理有限责任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

上半年，中国经济受疫情影响巨大，一季度经济出现大幅下降，二季度国内疫情有所缓解，国内经济处于逐渐恢复阶段，但国外疫情还处于高发阶段，六月份国内也有所反复，使得人们认识到

彻底消灭病毒还需要很长的一个过程。考虑到未来国内外都将对医疗领域加大投资，而且是个长期持续的过程，因此，本基金在上半年加大了医疗领域的投资，阶段性减持了部分地产公司，取得了较好的收益。

本基金在上半年仓位波动不大，继续保持中高仓位，我们还是坚持一贯的风格和策略，重点持有稳健成长的价值股，主要是估值合理、回报率较高，现金流优异的高端制造、医药、地产、家电、建材、食品饮料等行业龙头。在公司选择上，我们继续坚持选择具备核心竞争优势的白马龙头公司，通过深入的基本面和财务分析，把公司的投入资本回报率（ROIC）和公司业绩增速（g）与公司估值（pe）三者结合起来甄选个股，特别是高 ROIC、自由现金流良好、估值合理的优质公司是重点配置的对象。我们相信，随着时间的推移，高 ROIC 的优质公司一定会给投资者创造丰厚的回报，历史也不断验证了我们的判断。在投资上，我们坚持专注、坚守、理性、独立和长期的投资理念，不参与短期博弈和趋势投资，坚持与优质公司共同成长，通过对优质公司的深入研究和挖局，通过不同行业的配置和个股分散，来控制市场风险。

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 1.856 元，本报告期份额净值增长率为 39.13%，同期比较基准的增长率为 2.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为：第一，市场结构性分化进一步加剧，大量资金开始追逐确定性增长的行业，如医疗、消费领域和部分受益于国家产业政策的科技公司。目前这些行业整体估值较高，短期很难再有较好的低位介入时点，再叠加下半年科创板解禁，科技股会有一定抛压。第二，近期利率出现抬升，通胀预期有所抬头，货币政策边际上很难再宽松。第三，国外疫情可能面临二次冲击，中美关系正经历严峻考验，也对市场风险偏好产生抑制。因此，我们对下半年市场持中性态度，相对看好低估值、涨幅不高的板块，如家电、建材、地产、机械等领域，长期还是依然看好受益于中国庞大人口的消费和医疗产业，以及受益于中国工程师红利的先进制造业。

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

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华策略精选股票型证券投资基金

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	49,409,072.74	52,626,982.04
结算备付金		462,104.85	582,426.62
存出保证金		161,695.79	143,297.71
交易性金融资产	6.4.7.2	523,807,148.81	579,479,122.09
其中：股票投资		523,807,148.81	579,479,122.09
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,901,930.02	2,224,215.94
应收利息	6.4.7.5	6,833.82	7,250.10
应收股利		-	-
应收申购款		2,352,596.38	72,310.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		584,101,382.41	635,135,605.05
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		11,379,091.66	-
应付赎回款		5,219,356.92	5,740,659.82
应付管理人报酬		630,725.73	790,136.59
应付托管费		105,120.93	131,689.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	927,133.39	944,569.43
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	100,931.64	202,356.00
负债合计		18,362,360.27	7,809,411.29
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	304,853,188.03	470,314,311.55
未分配利润	6.4.7.10	260,885,834.11	157,011,882.21
所有者权益合计		565,739,022.14	627,326,193.76
负债和所有者权益总计		584,101,382.41	635,135,605.05

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.856 元，基金份额总额 304,853,188.03 份。

6.2 利润表

会计主体：新华策略精选股票型证券投资基金

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		163,853,608.80	187,221,686.49
1.利息收入		134,216.43	203,685.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	131,892.12	203,546.35
债券利息收入		-	139.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,324.31	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		81,411,202.92	49,346,827.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	77,902,921.53	40,347,835.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	213,254.14
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	3,508,281.39	8,785,737.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	81,678,357.89	137,290,840.88
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	629,831.56	380,332.42
减：二、费用		5,555,393.48	7,403,075.30
1. 管理人报酬		3,545,214.27	4,473,708.74
2. 托管费		590,868.93	745,618.09
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	1,299,776.28	2,058,015.91
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	0.32
7. 其他费用	6.4.7.18	119,534.00	125,732.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		158,298,215.32	179,818,611.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		158,298,215.32	179,818,611.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华策略精选股票型证券投资基金

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）	470,314,311.55	157,011,882.21	627,326,193.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	158,298,215.32	158,298,215.32
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）	-165,461,123.52	-54,424,263.42	-219,885,386.94
其中：1.基金申购款	88,057,443.53	47,501,133.95	135,558,577.48
2.基金赎回款	-253,518,567.05	-101,925,397.37	-355,443,964.42
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	304,853,188.03	260,885,834.11	565,739,022.14

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）	563,937,346.12	-93,991,916.21	469,945,429.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	179,818,611.19	179,818,611.19
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）	-69,027,661.72	-22,863,165.00	-91,890,826.72
其中：1.基金申购款	134,271,965.62	-5,074,990.20	129,196,975.42
2.基金赎回款	-203,299,627.34	-17,788,174.80	-221,087,802.14
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）	494,909,684.40	62,963,529.98	557,873,214.38

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

新华策略精选股票型证券投资基金(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[2015]66 号文件“关于核准新华策略精选股票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 2015 年 3 月 9 日至 3 月 27 日向社会公开募集，首次募集资金总额 4,069,427,511.95 元，其中募集净认购资金金额 4,068,919,005.90 元，募集资金产生利息 508,506.05 元，并经瑞华会计师事务所有限公司瑞华验字[2015]第 37100004 号验资报告予以验证。2015 年 3 月 31 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，存续期不固定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华策略精选股票型证券投资基金招募说明书》及《新华策略精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的

股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金股票资产投资比例为基金资产的 80%—95%；其中持有的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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》、《新华策略精选股票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）交易印花税征收方式，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《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。

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。

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	49,409,072.74
定期存款	-
其他存款	-
合计	49,409,072.74

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	348,014,236.82	523,807,148.81	175,792,911.99
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	348,014,236.82	523,807,148.81	175,792,911.99

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

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	6,581.19
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	252.63
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	6,833.82

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

报告期末，本基金未持有其他资产。

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	927,133.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	927,133.39

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	1,477.74
应付证券出借违约金	-
其他应付款	-
预提费用	99,453.90
合计	100,931.64

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	470,314,311.55	470,314,311.55
本期申购	88,057,443.53	88,057,443.53
本期赎回（以“-”号填列）	-253,518,567.05	-253,518,567.05
本期末	304,853,188.03	304,853,188.03

注：申购含红利再投资、转换转入份额，赎回含转换转出份额。

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	97,164,283.37	59,847,598.84	157,011,882.21
本期利润	76,619,857.43	81,678,357.89	158,298,215.32
本期基金份额交易产生的变动数	-40,751,617.86	-13,672,645.56	-54,424,263.42
其中：基金申购款	31,879,359.59	15,621,774.36	47,501,133.95
基金赎回款	-72,630,977.45	-29,294,419.92	-101,925,397.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,032,522.94	127,853,311.17	260,885,834.11

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	127,496.71
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	4,395.41
其他	-
合计	131,892.12

注：结算备付金利息收入中包含结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

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	516,003,462.76
减：卖出股票成本总额	438,100,541.23
买卖股票差价收入	77,902,921.53

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期，本基金无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.2 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期，本基金无赎回差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——申购差价收入

本报告期，本基金无申购差价收入。

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	3,508,281.39
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	3,508,281.39

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	81,678,357.89
——股票投资	81,678,357.89
——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	81,678,357.89

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	474,223.16
转换费收入	155,608.40
合计	629,831.56

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	1,299,776.28
银行间市场交易费用	-
合计	1,299,776.28

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	59,672.34
证券出借违约金	-
债券账户维护费	10,600.00
汇划手续费	9,480.10
其他	-
合计	119,534.00

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 2020 年 6 月 30 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
中国农业银行股份有限公司	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
恒泰证券股份有限公司	112,590,715.79	13.98%	87,807,211.50	6.09%

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	95,588.19	14.44%	99,755.70	10.78%
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	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	69,208.38	5.99%	69,208.38	5.72%

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。

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	3,545,214.27	4,473,708.74
其中：支付销售机构的客户维护费	1,453,488.69	1,964,877.47

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，上年度可比期间列示的支付销售机构的客户维护费为当期支付金额。

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	590,868.93	745,618.09

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同业市场的债券(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自有资金投资本基金的情况

报告期内，基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.10.4.2 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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		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
农业银行	49,409,072.74	127,496.71	50,579,310.94	192,493.79

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金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
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	网下中签	16.21	16.21	11,020.00	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	网下中签	16.42	16.42	7,894.00	129,619.48	129,619.48	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	网下中签	36.18	36.18	2,830.00	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	网下中签	11.33	11.33	8,337.00	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	网下中签	15.50	15.50	5,468.00	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	网下中签	6.94	6.94	1,420.00	9,854.80	9,854.80	-
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	-
30084	胜蓝	2020-0	2020-0	网下	10.01	10.01	751.00	7,517.00	7,517.00	-

3	股份	6-23	7-02	中签				51	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	-
300385	雪浪环境	2017-12-13	2020-12-14	非公开发行	11.56	5.77	259,459.00	2,999,989.60	1,497,078.43	2020-5-21 送股
300385	雪浪环境	2017-12-13	2021-12-14	非公开发行	11.56	5.52	259,461.00	3,000,019.20	1,432,224.72	2020-5-21 送股
688004	博汇科技	2020-06-05	2020-06-12	网下战略配售	28.77	71.90	2,500.00	71,925.00	179,750.00	-
688086	紫晶存储	2020-02-19	2020-02-26	网下战略配售	21.49	64.54	9,361.00	201,167.89	604,158.94	-
688126	沪硅产业	2020-04-13	2020-04-20	网下战略配售	3.89	26.34	189,286.00	736,322.54	4,985,793.24	-
688186	广大特材	2020-01-23	2020-02-11	网下战略配售	17.16	34.15	8,033.00	137,846.28	274,326.95	-
688228	开普云	2020-03-19	2020-03-27	网下战略配售	59.26	73.20	2,718.00	161,068.68	198,957.60	-
688520	神州细胞	2020-06-11	2020-06-22	网下战略配售	25.64	58.82	12,351.00	316,679.64	726,485.82	-
688555	泽达易盛	2020-06-12	2020-06-23	网下战略配售	19.49	56.80	3,004.00	58,547.96	170,627.20	-
688599	天合光能	2020-06-02	2020-06-10	网下战略配售	8.16	13.91	54,583.00	445,397.28	759,249.53	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

报告期末，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行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

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	49,409,072.74	-	-	-	49,409,072.74
结算备付金	462,104.85	-	-	-	462,104.85
存出保证金	161,695.79	-	-	-	161,695.79
交易性金融资产	-	-	-	523,807,148.81	523,807,148.81
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	7,901,930.02	7,901,930.02
应收利息	-	-	-	6,833.82	6,833.82
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,352,596.38	2,352,596.38
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	50,032,873.38	-	-	534,068,509.03	584,101,382.41

					1
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	-	-	-	11,379,091.66	11,379,091.66
应付赎回款	-	-	-	5,219,356.92	5,219,356.92
应付管理人报酬	-	-	-	630,725.73	630,725.73
应付托管费	-	-	-	105,120.93	105,120.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	927,133.39	927,133.39
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	100,931.64	100,931.64
负债总计	-	-	-	18,362,360.27	18,362,360.27
利率敏感度缺口	50,032,873.38	-	-	515,706,148.76	565,739,022.14
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	52,626,982.04	-	-	-	52,626,982.04
结算备付金	582,426.62	-	-	-	582,426.62
存出保证金	143,297.71	-	-	-	143,297.71
交易性金融资产	-	-	-	579,479,122.09	579,479,122.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,224,215.94	2,224,215.94
应收利息	-	-	-	7,250.10	7,250.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	72,310.55	72,310.55
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	53,352,706.37	-	-	581,782,898.68	635,135,605.05
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,740,659.82	5,740,659.82
应付管理人报酬	-	-	-	790,136.59	790,136.59
应付托管费	-	-	-	131,689.45	131,689.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	944,569.43	944,569.43
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	202,356.00	202,356.00
负债总计	-	-	-	7,809,411.29	7,809,411.29
利率敏感度缺口	53,352,706.37	-	-	573,973,487.39	627,326,193.76

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	523,807,148.81	92.59	579,479,122.09	92.37
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	523,807,148.81	92.59	579,479,122.09	92.37

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 1%		
	其他市场变量不变,沪深 300 指数下降 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%	5,478,813.08	5,529,678.55
	沪深 300 指数下降 1%	-5,478,813.08	-5,529,678.55

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	523,807,148.81	89.68
	其中：股票	523,807,148.81	89.68
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	49,871,177.59	8.54
8	其他各项资产	10,423,056.01	1.78
9	合计	584,101,382.41	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	490,404,614.28	86.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,250,000.00	0.40
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	3,944,856.57	0.70
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,400,032.64	3.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,995,040.00	0.71
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	2,799,839.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	523,807,148.81	92.59

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末，本基金未持有港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603338	浙江鼎力	560,000	42,431,200.00	7.50
2	601100	恒立液压	363,280	29,135,056.00	5.15
3	300639	凯普生物	559,100	29,034,063.00	5.13
4	002901	大博医疗	226,934	27,070,956.86	4.79
5	300326	凯利泰	900,000	26,190,000.00	4.63
6	300285	国瓷材料	666,850	22,346,143.50	3.95
7	600690	海尔智家	1,197,700	21,199,290.00	3.75
8	000333	美的集团	349,100	20,872,689.00	3.69
9	000656	金科股份	2,500,004	20,400,032.64	3.61
10	603489	八方股份	140,000	19,738,600.00	3.49
11	600585	海螺水泥	363,601	19,238,128.91	3.40
12	300206	理邦仪器	1,031,500	18,814,560.00	3.33
13	300482	万孚生物	160,680	16,710,720.00	2.95
14	603027	千禾味业	500,000	15,790,000.00	2.79
15	603583	捷昌驱动	228,600	15,631,668.00	2.76
16	600305	恒顺醋业	814,080	15,101,184.00	2.67
17	688006	杭可科技	295,851	13,295,543.94	2.35

18	002007	华兰生物	250,000	12,527,500.00	2.21
19	000877	天山股份	800,000	12,080,000.00	2.14
20	688139	海尔生物	200,486	11,239,245.16	1.99
21	002242	九阳股份	250,500	9,336,135.00	1.65
22	300396	迪瑞医疗	300,000	8,064,000.00	1.43
23	300685	艾德生物	100,000	7,696,000.00	1.36
24	002677	浙江美大	523,100	5,900,568.00	1.04
25	603369	今世缘	147,811	5,881,399.69	1.04
26	002372	伟星新材	500,072	5,815,837.36	1.03
27	000568	泸州老窖	59,300	5,403,416.00	0.96
28	002690	美亚光电	99,964	5,258,106.40	0.93
29	002832	比音勒芬	303,348	5,193,317.76	0.92
30	002833	弘亚数控	205,280	5,035,518.40	0.89
31	688126	沪硅产业	189,286	4,985,793.24	0.88
32	002773	康弘药业	100,000	4,960,000.00	0.88
33	300759	康龙化成	40,600	3,995,040.00	0.71
34	300633	开立医疗	100,600	3,988,790.00	0.71
35	603187	海容冷链	105,140	3,834,455.80	0.68
36	688169	石头科技	10,000	3,769,000.00	0.67
37	002803	吉宏股份	128,500	3,204,790.00	0.57
38	002035	华帝股份	300,000	3,039,000.00	0.54
39	300385	雪浪环境	518,920	2,929,303.15	0.52
40	300788	中信出版	58,100	2,799,839.00	0.49
41	600346	恒力石化	179,000	2,506,000.00	0.44
42	603123	翠微股份	300,000	2,250,000.00	0.40
43	600720	祁连山	133,800	2,174,250.00	0.38
44	603515	欧普照明	68,663	1,879,306.31	0.33
45	603429	集友股份	32,220	1,025,562.60	0.18
46	688599	天合光能	54,583	759,249.53	0.13
47	688520	神州细胞	12,351	726,485.82	0.13
48	688086	紫晶存储	9,361	604,158.94	0.11
49	000625	长安汽车	29,500	324,500.00	0.06
50	688186	广大特材	8,033	274,326.95	0.05
51	688228	开普云	2,718	198,957.60	0.04
52	688004	博汇科技	2,500	179,750.00	0.03
53	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.03
54	688555	泽达易盛	3,004	170,627.20	0.03
55	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
56	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
57	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
58	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
59	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
60	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
61	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00

62	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
63	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
64	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
65	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
66	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
67	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	000877	天山股份	14,688,589.00	2.34
2	300206	理邦仪器	14,533,383.90	2.32
3	603489	八方股份	12,127,303.00	1.93
4	603583	捷昌驱动	11,964,112.00	1.91
5	000799	酒鬼酒	11,228,492.00	1.79
6	002007	华兰生物	10,986,309.00	1.75
7	300639	凯普生物	10,352,903.00	1.65
8	603387	基蛋生物	10,231,711.56	1.63
9	300326	凯利泰	9,822,500.00	1.57
10	688139	海尔生物	7,819,649.17	1.25
11	300776	帝尔激光	7,610,281.00	1.21
12	000568	泸州老窖	6,890,942.00	1.10
13	300396	迪瑞医疗	5,996,722.00	0.96
14	002677	浙江美大	5,833,706.00	0.93
15	300285	国瓷材料	5,811,078.52	0.93
16	603338	浙江鼎力	5,786,267.88	0.92
17	002833	弘亚数控	5,190,675.00	0.83
18	002353	杰瑞股份	5,136,833.00	0.82
19	688358	祥生医疗	4,832,609.92	0.77
20	300059	东方财富	4,815,000.00	0.77

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	600048	保利地产	29,773,707.50	4.75

2	603338	浙江鼎力	24,174,024.80	3.85
3	000002	万科 A	19,939,548.65	3.18
4	600383	金地集团	19,670,823.40	3.14
5	000799	酒鬼酒	17,236,769.08	2.75
6	002372	伟星新材	14,872,969.00	2.37
7	000333	美的集团	14,055,567.32	2.24
8	603713	密尔克卫	13,835,181.00	2.21
9	000656	金科股份	13,729,883.76	2.19
10	601100	恒立液压	13,721,416.95	2.19
11	600563	法拉电子	13,400,833.61	2.14
12	000786	北新建材	12,610,600.00	2.01
13	601658	邮储银行	11,823,020.14	1.88
14	002146	荣盛发展	10,655,027.00	1.70
15	002035	华帝股份	10,367,789.65	1.65
16	603387	基蛋生物	10,183,097.55	1.62
17	600585	海螺水泥	9,946,281.00	1.59
18	300450	先导智能	8,706,857.60	1.39
19	600690	海尔智家	8,392,239.00	1.34
20	300776	帝尔激光	7,636,476.00	1.22

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	300,750,210.06
卖出股票的收入（成交）总额	516,003,462.76

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，不考虑相关费用。

7.5 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。

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

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属。

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

报告期末，本基金未持有权证。

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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 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。

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**

本基金合同尚无国债期货投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金持有的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，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。

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	161,695.79
2	应收证券清算款	7,901,930.02
3	应收股利	-
4	应收利息	6,833.82

5	应收申购款	2,352,596.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,423,056.01

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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

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
11,286	27,011.62	55,646,778.34	18.25%	249,206,409.69	81.75%

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	259,807.76	0.09%
------------------	------------	-------

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（新华策略）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（2015 年 3 月 31 日）基金份额总额	4,069,427,511.95
本报告期期初基金份额总额	470,314,311.55
本报告期基金总申购份额	88,057,443.53
减：本报告期基金总赎回份额	253,518,567.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	304,853,188.03

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末有涉及基金管理人、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

本报告期未发生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

本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	122,278,015.00	15.18%	98,482.23	14.88%	-
恒泰证券	2	112,590,715.79	13.98%	95,588.19	14.44%	-
东吴证券	1	109,772,478.99	13.63%	80,276.05	12.13%	-
国泰君安	1	78,329,609.53	9.72%	72,951.96	11.02%	-
国盛证券	2	77,167,423.35	9.58%	56,430.48	8.53%	-
兴业证券	1	57,533,867.02	7.14%	53,581.09	8.10%	-
中金公司	1	56,855,799.98	7.06%	52,953.49	8.00%	-
银河证券	1	49,752,019.85	6.18%	36,381.06	5.50%	-
信达证券	1	31,796,352.06	3.95%	23,253.45	3.51%	-
东兴证券	2	28,302,126.36	3.51%	20,697.21	3.13%	-
华西证券	1	27,116,347.60	3.37%	25,253.21	3.82%	-
浙商证券	1	14,364,927.86	1.78%	10,505.12	1.59%	-
招商证券	1	14,050,653.03	1.74%	13,085.95	1.98%	-
中信证券	2	12,922,316.54	1.60%	12,034.30	1.82%	-
华泰证券	1	5,363,692.87	0.67%	3,922.47	0.59%	-

国金证券	1	4,482,751.54	0.56%	4,174.94	0.63%	-
民生证券	2	2,100,294.79	0.26%	1,535.90	0.23%	-
光大证券	1	784,943.80	0.10%	730.98	0.11%	-

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。

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中国农业银行股份有限公司基金申购、	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、	2020-01-10

	定期定额投资业务费率优惠活动的公告	公司网站、电子信披网站	
2	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
3	新华策略精选股票型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-01-20
4	新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加华安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	2020-02-12
5	新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加粤开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	2020-03-07
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、电子信披网站	2020-03-26
7	新华策略精选股票型证券投资基金 2019 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2020-03-26
8	新华基金管理股份有限公司关于董事及独立董事变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	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、电子信披网站	2020-04-08
10	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
11	新华策略精选股票型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2020-04-21
12	新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加长江证券股份有限公司为销售机构的公告	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	2020-04-24
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、电子信披网站	2020-04-30
14	新华策略精选股票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	2020-05-12
15	新华策略精选股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-05-12
16	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
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
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加喜鹊财富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	2020-06-23
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	新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加重庆银行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	2020-06-29
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

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华策略精选股票型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华策略精选股票型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华策略精选股票型证券投资基金托管协议
- (四) 新华策略精选股票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《新华策略精选股票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