

新华家盈双利混合型证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十四日

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。本半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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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 2019 年 3 月 5 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.....	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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 本报告期投资基金情况.....	46
7.13 投资组合报告附注.....	46
8 基金份额持有人信息	47

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
9 开放式基金份额变动	48
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.9 其他重大事件	51
11 影响投资者决策的其他重要信息	52
12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华家盈双利混合型证券投资基金	
基金简称	新华家盈双利混合	
基金主代码	006155	
交易代码	006155	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 5 日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	78,740,874.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华家盈双利混合 A	新华家盈双利混合 C
下属分级基金的交易代码	006155	006156
报告期末下属分级基金的份额总额	37,934,019.85 份	40,806,854.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以有效控制风险、追求稳健收益为目标，主要投资于债券等固定收益类资产，辅以股票投资增强收益，力争实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金以债券等固定收益类投资为主，通过债券等固定收益类资产的投资获取稳健收益，并适度参与股票等权益类资产的投资以增强回报。投资策略主要包括大类资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券及权证策略等。
业绩比较基准	上证国债指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等预期风险、中等预期收益品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	张燕
	联系电话	010-68779688	0755-83199084
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008198866	95555
传真		010-68779528	0755-83195201

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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	400010	518040
法定代表人	陈重	李建红

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座

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(2019年3月5日(基金合同生效日)至2019年6月30日)	
	新华家盈双利混合 A	新华家盈双利混合 C
本期已实现收益	418,432.91	724,477.38
本期利润	74,997.01	124,403.47
加权平均基金份额本期利润	0.0019	0.0011
本期加权平均净值利润率	0.19%	0.11%
本期基金份额净值增长率	0.22%	0.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	新华家盈双利混合 A	新华家盈双利混合 C
期末可供分配利润	82,386.99	7,362.87
期末可供分配基金份额利润	0.0022	0.0002
期末基金资产净值	38,016,406.84	40,814,217.63
期末基金份额净值	1.0022	1.0002
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
	新华家盈双利混合 A	新华家盈双利混合 C
基金份额累计净值增长率	0.22%	0.02%

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）；

4、本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华家盈双利混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.80%	0.11%	1.68%	0.30%	-0.88%	-0.19%
过去三个月	0.06%	0.14%	0.39%	0.38%	-0.33%	-0.24%
自基金合同生效至今	0.22%	0.12%	1.22%	0.39%	-1.00%	-0.27%

注：1、本基金的业绩比较基准为上证国债指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×25%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

新华家盈双利混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.76%	0.11%	1.68%	0.30%	-0.92%	-0.19%
过去三个月	-0.11%	0.14%	0.39%	0.38%	-0.50%	-0.24%
自基金合同生效至今	0.02%	0.12%	1.22%	0.39%	-1.20%	-0.27%

注：1、本基金的业绩比较基准为上证国债指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×25%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

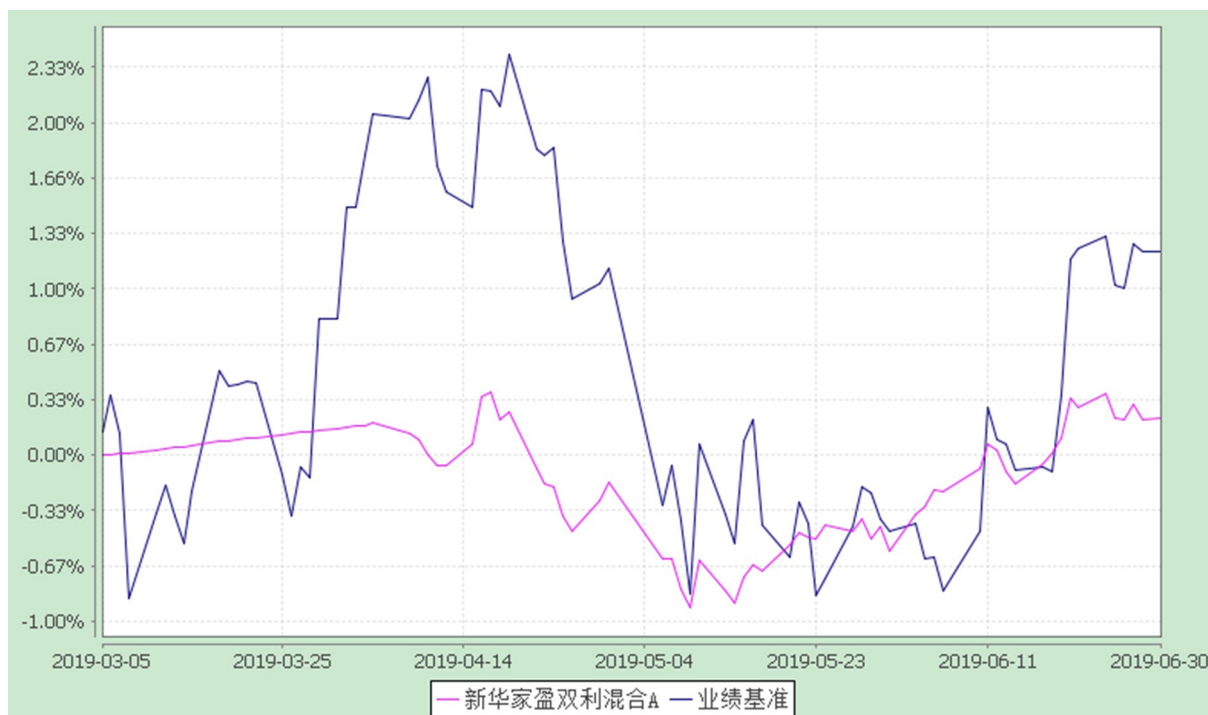
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华家盈双利混合型证券投资基金

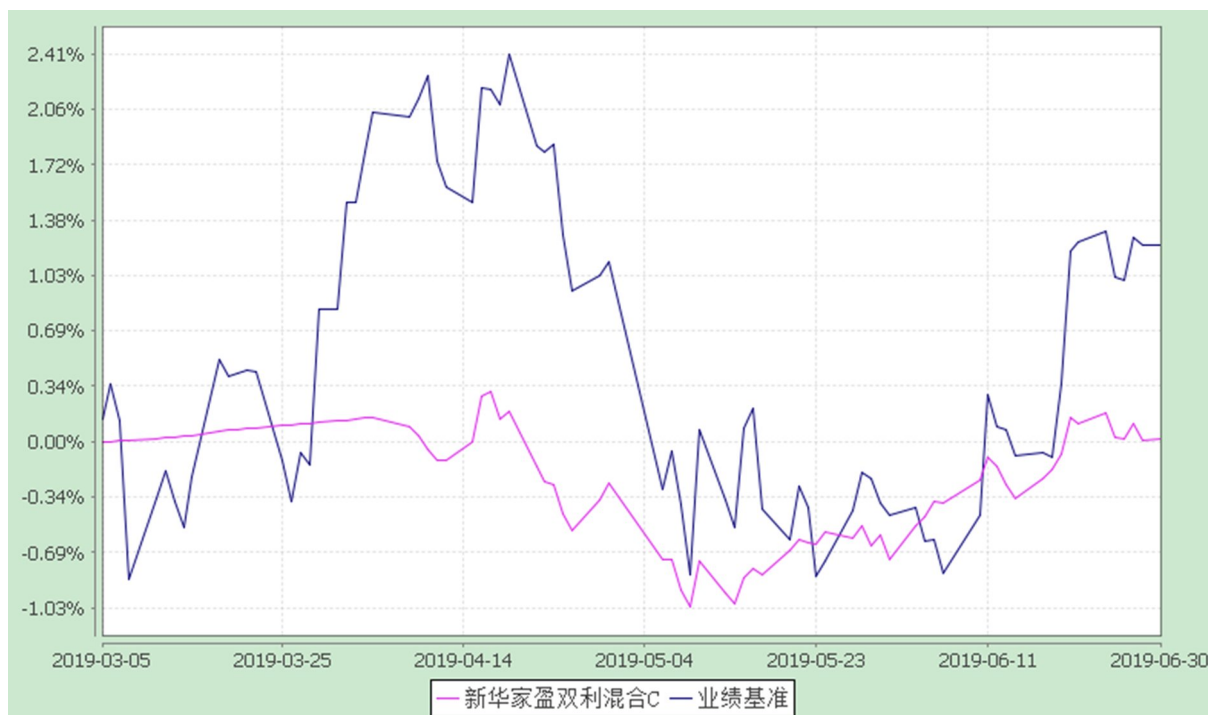
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2019 年 3 月 5 日至 2019 年 6 月 30 日）

新华家盈双利混合 A



新华家盈双利混合 C



注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金建仓期为 6 个月，截止报告期末基金处于建仓期。

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 2019 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十四只开放式基金，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、新华恒稳添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、新华高端制造灵活配置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、新华家盈双利混合型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金和新华鼎利债券型证券投资基金。

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		
于泽雨	本基金基金经	2018-03-0	-	11	经济学博士，历任华安财产保险公

	理，新华基金管理股份有限公司投资总监助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理、新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)基金经理、新华安享惠钰定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理。	5			司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理。
--	---	---	--	--	------------------------

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。

4.2 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家盈双利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》、《新华家盈双利混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，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

2019 年上半年国内经济增长乏力，市场预期较为悲观。地产销售边际走弱、资金压力显现，拖累房地产投资增速。制造业景气度下滑导致工业增加值持续走低，但基建支撑上游利润增速维持高位，下游企业经营预期有所改善。基建投资回升，对冲固定资产投资下行压力。对外贸易方面，出

口增速受全球经济下行和贸易战影响回落较快，国内生产承压对进口的影响正逐步显现。通胀方面，受食品价格超预期上涨影响 CPI 温和抬升，PPI 中枢则持续下移；货币政策中性偏宽松，银行间市场流动性宽裕。

债券市场方面，由于前期收益率已回落至历史较低水平，在市场预期较为一致的情况下，长久期利率债仅维持区间震荡态势。银行间市场资金面持续宽松，回购利率屡创新低，带动短端信用债收益率持续下行。具体看：利率债短端上行约 10bp，长端的 10 年期国债收益率上行 5bp 至 3.22%，10 年期国开债上行 1bp 至 3.61%，估值位于历史 1/4 分位数附近；短端各评级信用债收益率均下行 30-40bp，长端各评级信用债收益率普遍下行 5-10bp。

债券投资方面，考虑到宏观政策的方向和重点已经出现调整，长期债券的收益率已处在偏低位置，市场波动性可能变大，本基金还是以持有短期限企业债获取利息收益为主。目前资金成本持续下降，同时部分中等级信用债被错杀，短端中等级信用债估值和安全性更具吸引力，有相对稳定的套息空间。重点持有国资委百分之百控股、负债率相对适中、有一定竞争力的国有企业与行业龙头企业发行的债券。

转债投资方面，目前主要配置了正股较为低估、转股溢价率较低的个别银行转债。

股票投资方面，目前主要配置了估值较低的大银行。大银行估值目前处于历史最低区间，高分红率又使其兼具固定收益产品属性，未来具备估值修复空间。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 06 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0022 元，本报告期份额净值增长率为 0.22%，同期比较基准收益率为 1.22%；本基金 C 类份额净值为 1.0002 元，本报告期份额净值增长率为 0.02%，同期比较基准收益率为 1.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面整体处于衰退周期尾声，虽然市场预期偏悲观，但是更需关注潜在动能带来的积极影响，如：财政政策在稳投资、柔性去杠杆、支持高质量发展等方面的投入会明显加大，监管层通过提供流动性呵护经济的意图非常明确，信贷投放加大力度以对冲商业银行表外业务收缩带来的影响、着力打通信用传导的各个环节，减税降费带动居民消费支出增加，中美贸易战阶段性缓和等。

总体而言，经济正处于长周期改善的过程中，短期向下空间有限，接下来随着政策对冲发力、财政政策更加积极、房地产库存改善、社融增速逐步企稳回升，实体经济的投融资活动可能恢复活跃。在市场悲观预期较为一致的情况下，基本面上的利空因素造成的边际影响将越来越小，未来应关注政策对冲发力后市场和经济的变化，在政府通过积极的财政政策大力加杠杆后，长久期利率债

收益率大概率维持区间震荡。短端中等评级信用债估值和安全性更具吸引力，有相对稳定的套息空间。重点关注国资控股、负债率相对适中、有一定竞争力的国有企业与行业龙头企业发行的债券。

可转债投资方面，转债市场持续扩容后可选择的潜在投资标的增多，正股基本面良好的转债将更具弹性优势。近期权益市场波动剧烈，但转债体现出较强的抗跌能力，随着债券价格的回落，由债性所提供的安全垫决定转债的底部价格。总体而言，转债向下空间有限，我们将通过在二级市场低吸筹码进行择机配置，重点关注转股溢价率低、流动性好、正股估值低、业绩优异的大盘转债，主要配置方向为银行、周期和公共事业等主体的转债。

股票投资方面，目前权益市场具备相对估值优势和充足的流动性，长期看趋势向好，但是短期内压制市场上涨因素仍在，仍需谨防预期外的杀跌。本基金目前持有大银行，由于持有的标的总体上属于低估值、类债券品种，且企业未来经营向好，对估值修复有支持和保障，所以本基金接下来主要选择继续持有这些品种。

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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度, 我行在履行托管职责中, 严格遵守有关法律法规、托管协议的规定, 尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款, 对托管产品的投资行为进行监督, 并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则, 独立地设置、登录和保管本产品的全套账册, 进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确, 不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体: 新华家盈双利混合型证券投资基金

报告截止日: 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
资产:		-
银行存款	6.4.7.1	2,273,442.46
结算备付金		-
存出保证金		5,429.99

交易性金融资产	6.4.7.2	77,576,687.89
其中：股票投资		13,093,955.19
基金投资		-
债券投资		64,482,732.70
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	1,820,017.97
应收股利		-
应收申购款		149,748.45
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		81,825,326.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30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		2,000,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		824,102.45
应付管理人报酬		67,703.88
应付托管费		13,540.77
应付销售服务费		18,056.24
应付交易费用	6.4.7.7	23,996.24
应交税费		14,431.41
应付利息		836.70
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	32,034.60
负债合计		2,994,702.29
所有者权益：		-
实收基金	6.4.7.9	78,740,874.61
未分配利润	6.4.7.10	89,749.86
所有者权益合计		78,830,624.47
负债和所有者权益总计		81,825,326.76

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年，A 类基金份额净值 1.0022 元，A 类基金份额总额 37934019.85 份，B 类基金份额净值 1.0002 元，B 类基金份额总额 40806854.76 份。

6.2 利润表

会计主体：新华家盈双利混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		1,108,111.96
1.利息收入		2,375,924.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	490,185.52
债券利息收入		1,406,929.10
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		478,810.31
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-339,920.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,752.57
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.14	-730,844.72
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	6.4.7.18	383,171.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-943,509.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	15,617.73
减：二、费用		908,711.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	488,565.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	97,712.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	179,643.02
4. 交易费用	6.4.7.21	16,669.13
5. 利息支出		83,668.71
其中：卖出回购金融资产支出		83,668.71
6.税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.22	42,452.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		199,400.48
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		199,400.48

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华家盈双利混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 5 日（基金合同生效日）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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	199,400.48	199,400.48
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）	78,740,874.61	-109,650.62	78,631,223.99
其中：1.基金申购款	294,885,386.10	-726.87	294,884,659.23
2.基金赎回款	-216,144,511.49	-108,923.75	-216,253,435.24
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）	78,740,874.61	89,749.86	78,830,624.47

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日成立，报告截止日 2019 年 06 月 30 日未满一年。

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：陈重，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

新华家盈双利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2018】1015 号文《关于准予新华家盈双利混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，由新华基金管理股份有限公司发起募集的契约型开放式混合型证券投资基金，存续期不固定。于 2018 年 12 月 18 日通过新华基金管理股份有限公司的直销中心和取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议代为办理基金销售业务的代销机构公开发售，发行期限：2018 年 12 月 18 日至 2019 年 02 月 28 日。首次募集资金总额 294,276,669.23 元，其中募

集资金产生利息 23,547.06 元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2019]第 01360006 号验资报告予以验证。2019 年 03 月 05 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。申请发行基金募集份额不少于 2 亿份，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《新华家盈双利混合型证券投资基金招募说明书》及《新华家盈双利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、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、（超）短期融资券）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 60%；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的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。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较标准为：上证国债指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×25%。

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 2019 年 08 月 23 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 42 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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财务状况、经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 06 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。

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。

6.4.4.4 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，于交易日按取得时的公允价值作为

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的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等，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。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，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

（2）债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息（作为应收利息单独核算）。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

（3）权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证), 在除权日按照持有的股数及获赠比例, 计算确定增加的权证数量, 成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证, 于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊, 确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日, 按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本, 按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后, 上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5) 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账, 相关交易费用计入初始成本。

买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

(6) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账, 相关交易费用计入初始成本。

卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

公允价值, 是指市场参与者在计量日发生的有序交易中, 出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债, 假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行; 不存在主要市场的, 本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。

存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的

价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

（2）主要资产的估值方法

① 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

② 债券投资

对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种（含上交所可交换债），选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值净价作为公允价值。

对在交易所市场上市交易的可转换债券（含深交所可交换债券），采用交易所每日收盘价（估值全价）扣减上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券、私募债券和未上市债券，采用成本估值。

对于银行间市场上的固定收益品种，选取中国债券登记结算有限公司提供的相应品种当日的估值净价加上上一起息日至估值日每百元债券的税前应计利息（算头算尾）减去上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

③ 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的管理人应根据具

体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于月末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提；

(3) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.5% 年费率计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等收益分配权；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

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、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》：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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方

教育费附加。

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。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。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,273,442.46
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,273,442.46

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,594,541.39	13,093,955.19	-500,586.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	9,337,821.80	8,891,732.70	-446,089.10
交易所市场			

	银行间市场	55,587,834.51	55,591,000.00	3,165.49
	合计	64,925,656.31	64,482,732.70	-442,923.61
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		78,520,197.70	77,576,687.89	-943,509.81

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本报告期末本基金未持有买断式逆回购取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	353.36
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	2.40
应收债券利息	1,819,662.21
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	-
其他	-
合计	1,820,017.97

注：1、本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

2、应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	10,330.27
银行间市场应付交易费用	13,665.97
合计	23,996.24

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	776.40
其他应付款	-
预提费用	31,258.20
合计	32,034.60

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.7.9 实收基金

新华家盈双利混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
本期申购	42,406,214.56	42,406,214.56
本期赎回（以“-”号填列）	-4,472,194.71	-4,472,194.71
本期末	37,934,019.85	37,934,019.85

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。申购含转入份额，赎

回含转出份额。

新华家盈双利混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
本期申购	252,479,171.54	252,479,171.54
本期赎回（以“-”号填列）	-211,672,316.78	-211,672,316.78
本期末	40,806,854.76	40,806,854.76

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。申购含转入份额，赎回含转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

新华家盈双利混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	418,432.91	-343,435.90	74,997.01
本期基金份额交易产生的变动数	-17,352.37	24,742.35	7,389.98
其中：基金申购款	529.30	-1,077.26	-547.96
基金赎回款	-17,881.67	25,819.61	7,937.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	401,080.54	-318,693.55	82,386.99

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

新华家盈双利混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	724,477.38	-600,073.91	124,403.47
本期基金份额交易产生的变动数	-374,564.40	257,523.80	-117,040.60
其中：基金申购款	2,442.54	-2,621.45	-178.91
基金赎回款	-377,006.94	260,145.25	-116,861.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	349,912.98	-342,550.11	7,362.87

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
活期存款利息收入	36,316.67
定期存款利息收入	453,466.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	402.18
其他	0.00
合计	490,185.52

注：1、本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

2、结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
卖出股票成交总额	330,803.20
减：卖出股票成本总额	323,050.63
买卖股票差价收入	7,752.57

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期内未持有基金投资。

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	94,601,486.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	92,031,313.01
减：应收利息总额	3,301,017.97
买卖债券差价收入	-730,844.72

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期内未持有资产支持证券投资。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本本基金本报告期内未持有贵金属投资。

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期内未持有衍生工具投资。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	383,171.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	383,171.26

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
1.交易性金融资产	-943,509.81
——股票投资	-500,586.20
——债券投资	-442,923.61
——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	-943,509.81

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
基金赎回费收入	15,617.73
合计	15,617.73

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
交易所市场交易费用	11,956.63
银行间市场交易费用	4,712.50
合计	16,669.13

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
审计费用	31,258.20
信息披露费	-
债券账户维护费	0.00
汇划手续费	6,357.00
其他	-
税金及附加	4,837.40
合计	42,452.60

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

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

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。截至 2019 年 06 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

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效,至本报告期末未满一年。截至财务报告批准报出日,本基金无须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
招商银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人

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

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效,至本报告期末未满一年。本基金本报告期内未通过关联交易单元进行交易。

6.4.10.1.1 股票交易

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效,至本报告期末未满一年。本基金本报告期内未通过关联交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效,至本报告期末未满一年。本基金本报告期内未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效,至本报告期末未满一年。本基金本报告期内未通过关联交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效,至本报告期末未满一年。本基金本报告期内未通过关联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

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

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
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	488,565.04
其中：支付销售机构的客户维护费	252,093.51

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 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 × (1.0% ÷ 当年天数)。

2、本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	97,712.98

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法为：每日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% ÷ 当年天数。

2、本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华家盈双利混合 A	新华家盈双利混合 C	合计
招商银行股份有限公司	-	31,744.51	31,744.51
新华基金管理股份有限公司	-	62,103.06	62,103.06
合计	-	93,847.57	93,847.57

注：1、C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。托管费的计算方法为：C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.5%÷当年天数。

2、A 类基金份额不收取销售服务费。

3、本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

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

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券交易。

6.4.10.4 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	
	2019年3月5日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	2,273,442.46	36,316.67

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

6.4.10.6.1 其他关联交易事项的说明

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

新华家盈双利混合 A

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期无收益分配事项。

新华家盈双利混合 C

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期无收益分配事项。

6.4.12 期末（2019 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
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	网下中签	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金期末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

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。截止 2019 年 06 月 30 日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,000,000.00 元，2019 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。截止 2019 年 06 月 30 日，已质押债券有：16 国债 16（019544）质押 1,960 张，18 国债 18（019600）质押 25,000 张，光大转债（113011）质押 42,180 张。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 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 2019年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	30,180,000.00
合计	30,180,000.00 }

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日
AAA	4,613,900.00
AAA 以下	25,491,894.70
未评级	4,196,938.00
合计	34,302,732.70

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。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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。

6.4.13.4.2 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.2.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	2,273,442.46	-	-	-	2,273,442.46
结算备付金	-	-	-	-	-

存出保证金	5,429.99	-	-	-	5,429.99
交易性金融资产	54,607,938.00	9,752,312.00	122,482.70	13,093,955.19	77,576,687.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,820,017.97	1,820,017.97
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	149,748.45	149,748.45
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	56,886,810.45	9,752,312.00	122,482.70	15,063,721.61	81,825,326.76
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	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	824,102.45	824,102.45
应付管理人报酬	-	-	-	67,703.88	67,703.88
应付托管费	-	-	-	13,540.77	13,540.77
应付销售服务费	-	-	-	18,056.24	18,056.24
应付交易费用	-	-	-	23,996.24	23,996.24
应交税费	-	-	-	14,431.41	14,431.41
应付利息	-	-	-	836.70	836.70
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	32,034.60	32,034.60
负债总计	2,000,000.00	-	-	994,702.29	2,994,702.29
利率敏感度缺口	54,886,810.45	9,752,312.00	122,482.70	14,069,019.32	78,830,624.47

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。

6.4.13.4.2.2 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 25 个基点；	
	其他市场变量不变，市场利率下降 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：人民币万元）	
	本期末 2019 年 6 月 30 日	
市场利率上升 25.00 bp		减少约 4
市场利率下降 25.00 bp		增加约 4

注：本基金管理人运用 XRisk Suite 风险控制系统对本基金投资组合中的银行存款、结算备付金、存出保证金和债券类资产做出以上利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.4 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。

6.4.13.4.4.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	13,093,955.19	16.61
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	64,482,732.70	81.80
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	77,576,687.89	98.41

6.4.13.4.4.2 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：人民币万元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	
	沪深 300 指数上升 1%		增加约 9
	沪深 300 指数下降 1%		增加约 9

注：本基金管理人运用 XRisk suite 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价格风险的敏感性分析。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。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	13,093,955.19	16.00
	其中：股票	13,093,955.19	16.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	64,482,732.70	78.81
	其中：债券	64,482,732.70	78.81
	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	2,273,442.46	2.78
8	其他各项资产	1,975,196.41	2.41
9	合计	81,825,326.76	100.00

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

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	41,932.60	0.05
C	制造业	41,858.05	0.05
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	36,965.60	0.05
J	金融业	12,973,198.94	16.46
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	-	-
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	-	-
	合计	13,093,955.19	16.61

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601288	农业银行	2,203,400	7,932,240.00	10.06
2	601398	工商银行	850,100	5,007,089.00	6.35
3	600968	海油发展	11,812	41,932.60	0.05
4	601698	中国卫通	9,430	36,965.60	0.05
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.04
6	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.03
7	603863	松炆资源	645	14,886.60	0.02

注：本基金于 2019 年 03 月 05 日基金合同生效，至本报告期末未满一年。

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	8,785,822.00	11.15
2	601398	工商银行	5,009,478.00	6.35
3	601236	红塔证券	33,869.94	0.04
4	601698	中国卫通	25,649.60	0.03
5	600968	海油发展	24,096.48	0.03
6	603867	新化股份	17,023.05	0.02
7	603915	国茂股份	15,235.20	0.02
8	603863	松炆资源	6,417.75	0.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	296,800.00	0.38
2	603915	国茂股份	34,003.20	0.04

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	13,917,592.02
卖出股票的收入（成交）总额	330,803.20

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	2,698,039.20	3.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,498,898.80	1.90
	其中：政策性金融债	1,498,898.80	1.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,180,000.00	38.28
6	中期票据	25,411,000.00	32.23
7	可转债（可交换债）	4,694,794.70	5.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	64,482,732.70	81.80

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

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	101800622	18 开封基建 MTN001	50,000	5,180,000.00	6.57
2	101464029	14 新余钢铁 MTN001	50,000	5,086,500.00	6.45
3	101463011	14 新庐陵 MTN001	50,000	5,079,000.00	6.44
4	101660056	16 内蒙电	50,000	5,037,000.00	6.39

		投 MTN002			
5	011802229	18 益阳交 通 SCP001	50,000	5,037,000.00	6.39

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

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

本基金本报告期尚无股指期货投资策略。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,429.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,820,017.97
5	应收申购款	149,748.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,975,196.41

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	4,572,312.00	5.80

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.04	新股未上市

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
新华家盈双利混合 A	487	77,893.26	0.00	0.00%	37,934,019.85	100.00%
新华家盈双利混合 C	375	108,818.28	10,149,284.24	24.87%	30,657,570.52	75.13%
合计	862	91,346.72	10,149,284.24	12.89%	68,591,590.37	87.11%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	新华家盈双利混合 A	99.14	0.00%
	新华家盈双利混合 C	0.00	0.00%
	合计	99.14	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	新华家盈双利混合 A	0
	新华家盈双利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华家盈双利混合 A	0
	新华家盈双利混合 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华家盈双利混合 A	新华家盈双利混合 C
基金合同生效日(2019年3月5日)基金份额总额	42,271,734.00	252,004,935.23
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	134,480.56	474,236.31
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	4,472,194.71	211,672,316.78
基金合同生效日起至报告期期末	-	-

基金拆分变动份额		
本报告期末基金份额总额	37,934,019.85	40,806,854.76

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2019 年 4 月 18 日，陈重先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司董事长。

2019 年 4 月 18 日，张宗友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。

2019 年 4 月 18 日，张宗友先生新任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司董事长，代任总经理。

2019 年 6 月 6 日，刘全胜先生新任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司总经理。

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

华创证券	1	14,126,103.20	100.00%	10,330.27	100.00%	-
------	---	---------------	---------	-----------	---------	---

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》（证监基金字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用3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济商的排名。

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。

10.8.2 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

广发证券	1,499,647.69	14.30%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	8,990,841.10	85.70%	33,100,000.00	100.00%	-	-

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新华家盈双利混合型证券投资基金延长募集期的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2019-01-14
2	新华基金管理股份有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2019-01-26
3	新华基金管理股份有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2019-01-29
4	新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加恒泰证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2019-02-01
5	新华家盈双利混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、公司网站	2019-03-06
6	新华基金管理股份有限公司关于新华家盈双利混合型证券投资基金增加华夏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2019-03-29
7	新华家盈双利混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报、公司网站	2019-04-01
8	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在招商银行开通定期定额投资业务、基金转换业务的公告	中国证券报、公司网站	2019-04-13
9	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	证券时报、公司网站	2019-04-20
10	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2019-05-08
11	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	证券时报、公司网站	2019-06-11
12	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2019-06-24
13	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2019 年半年度最后一日交易日资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2019-06-29

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家盈双利混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华家盈双利混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华家盈双利混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华家盈双利混合型证券投资基金基金合同
- (五) 新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六) 《新华家盈双利混合型证券投资基金招募说明书》
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (九) 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

二〇一九年八月二十四日