

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)
2020 年第 3 季度报告
2020 年 9 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：二〇二〇年十月二十七日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 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。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华精选成长主题 3 个月持有期混合(FOF)
基金主代码	009146
交易代码	009146
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 26 日
报告期末基金份额总额	46,248,444.36 份
投资目标	本基金将精选具有成长风格的金牛基金以及其他优质基金构建投资组合，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略包括资产配置策略、基金投资策略、债权投资策略。 本基金运用定量与定性相结合的研究方法进行基金精选，对国内公开募集的开放式证券投资基金的业绩、风险、持仓、规模、

	<p>持有人结构和费率等要素进行定量分析,对拟投资的基金投资策略、决策流程、风险措施、基金经理、投资团队、研究支持和公司管理等要素进行定量及定性分析,自下而上精选出投资能力稳健、持续业绩良好、投资风格稳定的基金。</p> <p>基金管理人将同时入选金牛成长核心基金池和重点投资基金池的优质基金组成“精选成长组合”。本基金以“精选成长组合”为投资重点,辅以全市场精选出的优质基金构建投资组合,在保持适度流动性、控制风险的前提下增厚组合收益。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金,其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金,高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金。
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

§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 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	24,314,399.32
2.本期利润	17,463,484.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.1493
4.期末基金资产净值	53,032,775.54
5.期末基金份额净值	1.1467

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、本基金合同生效日为2020年04月26日，截至本报告期末未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	7.97%	1.12%	3.24%	1.00%	4.73%	0.12%
自基金合同生效起至今	14.67%	0.93%	9.28%	0.86%	5.39%	0.07%

注：1.本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%；

2.本基金合同生效日为2020年04月26日，截至本报告期末未满一年。

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

新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)
 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4月26日至2020年9月30日）



注：本基金合同于2020年4月26日生效，截至本报告期末未满一年。本基金建仓期为6个月，本报告期，本基金处于建仓期。

§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		
王奕蕾	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司基金投	2020-04-26	-	8	金融学硕士，历任方正证券股份有限公司研究所研究员，先后担任固定收益分析师和基金分析师，新华基金投资经理。

	资部 总监。				
李强	本基 基金 基金 经理，新 华基 基金 管 理 股 份 有 限 公 司 产 品 开 发 部 总 监。	2020-04-26	-	13	投资分析硕士，历任大成基金管理有限公司产品设计师、工银瑞信基金管理有限公司产品经理、国泰基金管理有限公司高级产品经理，负责国内外基金行业的研究、公募基金产品以及特定客户资产管理计划的研究、设计和开发。

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精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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 报告期内基金的投资策略和运作分析

随着本基金建仓期即将到期，产品权益资产仓位略有提升，开始逐渐向合同规定投资比例靠拢，未来主要配置以成长风格为主的主动管理型权益基金为主。考虑到为客户尽量获得稳健收益的主要目标，同时由于疫情对经济的影响，我们也选择了一些基建相关、内需相关的确定性较强的板块进行分散投资，避免超预期因素导致净值剧烈波动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.1467 元，本报告期份额净值增长率为 7.97%，同期业绩比较基准的增长率为 3.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内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 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	48,478,059.56	89.17
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	5,504,378.26	10.12
8	其他各项资产	382,624.88	0.70
9	合计	54,365,062.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股股票。

5.3 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2本基金未投资股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,735.83
2	应收证券清算款	353,713.50
3	应收股利	-
4	应收利息	1,010.87
5	应收申购款	22,164.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	382,624.88

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

5.11.6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。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	162712	广发聚利债券(LOF)A	契约型开放式	3,447,823.99	4,941,766.12	9.32%	否
2	163415	兴全商业模式优选混合(LOF)	契约型开放式	1,366,907.64	4,391,874.25	8.28%	否
3	002692	富国创新科技混合	契约型开放式	1,845,142.23	4,278,884.83	8.07%	否
4	161606	融通行业景气混合	契约型开放式	1,655,593.22	4,251,563.39	8.02%	否
5	519700	交银主题优选混合	契约型开放式	2,072,423.03	3,976,979.79	7.50%	否
6	004231	中欧行业成长混合(LOF)C	契约型开放式	1,816,234.91	3,707,298.70	6.99%	否
7	002743	泓德裕祥债券C	契约型开放式	2,548,467.67	3,017,385.72	5.69%	否
8	260109	景顺长城内需贰号混合	契约型开放式	1,653,215.52	2,903,046.45	5.47%	否
9	001500	泓德远见回报混合	契约型开放式	1,523,540.09	2,893,202.63	5.46%	否
10	000584	新华鑫益灵活配置混合	契约型开放式	735,022.14	2,874,671.59	5.42%	是

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费	0.00	-
当期交易基金产生的赎回费	482,282.10	-

(元)		
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	40,549.38	5,366.04
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	353,329.84	20,774.63
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	66,551.46	3,618.28
当期持有基金产生的交易费(元)	638.81	-
当期持有基金产生的转换费(元)	20,020.27	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金持有的基金未发生重大影响事件。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	223,457,744.62
本报告期期间基金总申购份额	2,234,480.33

减：本报告期期间基金总赎回份额	179,443,780.59
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	46,248,444.36

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

--

注：本报告期内无基金管理人持有本基金份额的情况。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末有影响投资者决策的其他重要信息。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)募集的文件
- （二）关于申请募集新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)之法律意见书
- （三）《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)托管协议》

- (四)《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)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)《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》
- (七)《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)产品资料概要》(更新)
- (八) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (九) 基金托管人业务资格批件及营业执照

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

10.3 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。