

新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 日

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年四月二十二日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 17 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	新沃通盈灵活配置混合
交易代码	002564
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日
报告期末基金份额总额	17,499,698.23 份
投资目标	本基金以风险管理为前提，通过把握中国稳增长与促转型的发展现状，灵活运用多种投资策略，挖掘各大类资产配置机会，力求高于业绩比较基准的长期资产增值。
投资策略	本基金在深度把握中国经济发展与转型的基础上，通过自上而下的宏观-中观-微观的资产配置策略，以及自下而上的精选行业、个股的基本面分析策略，再通过定性分析和定量分析相结合的选股方法，辅以多种事件驱动、量化研究等工具策略，在风险管理的前提下因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产长期增值。
业绩比较基准	65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	新沃基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 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1月1日—2020年3月31日）
1. 本期已实现收益	314,991.11
2. 本期利润	-2,148,266.63
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2686
4. 期末基金资产净值	20,301,399.13
5. 期末基金份额净值	1.160

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、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，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 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	1.31%	3.00%	-5.81%	1.27%	7.12%	1.73%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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		
陈乐华	本基金的基金经理、投资研究部研究总监	2019年9月30日	-	13年	中央财经大学金融学硕士，中国籍。2007年7月至2010年5月任职于中信建投证券，担任研究发展部经理；2010年5月至2016年10月任职于华宝兴业基金管理有限公司，历任基金经理

					助理、基金经理、高级分析师等职务；2016 年 11 月至 2018 年 8 月任职于北信瑞丰基金管理有限公司，担任基金经理；2018 年 9 月加入新沃基金管理有限公司，任投资研究部研究总监，现任新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
俞璥	本基金的基金经理	2018 年 6 月 28 日	-	7 年	复旦大学硕士，中国籍。2013 年 7 月至 2016 年 9 月任职于国金证券，历任证券交易员、投资经理、投资主办；2016 年 10 月加入新沃基金管理有限公司，现任新沃通宝货币市场基金基金经理、新沃通利纯债债券型证券投资基金基金经理、新沃通盈灵活配置混合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

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为公平对待投资者，保护投资者利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做出明确具体的规定。本报告期内，本基金管理人严格执行相关规定，通过系统和人工等各种

方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年 1 季度，新冠肺炎病毒开始肆虐全球，对全球经济短期造成了非常大的打击。国内由于及早采取了武汉封城等严格的隔离措施，使得疫情得到了很快的控制。但中国的经济短期也受到了非常大的影响，从公布的 1-2 月经济数据来看，社会消费品零售总额下降 20.5%，固定资产投资总额下降 24.5%，以人民币计算的出口总值下降 15.9%，进口总值下降 2.4%。

由于疫情影响，全球股市在一季度出现了较大幅度的暴跌。A 股虽然短期内就完成了因为国内疫情恐慌造成的调整，但在外围股市连续大跌的背景下，投资人的信心也受到很大影响，A 股又在 3 月份出现连续下跌。报告期内，市场先扬后抑，除创业板指数外，各主要股指均出现了不同幅度的下跌，其中，上证 50 和沪深 300 分别下跌了 12.2%和 10.02%，上证指数下跌 9.83%，深成指下跌 4.49%，中小板指数下跌 1.94%。创业板指数虽然冲高回落，但依然累计上涨 4.1%。板块表现方面（中信一级行业指数），仅有农林牧渔、医药、计算机、通信和建材行业收涨，行业指数分别上涨 16.02%、8.22%、2.86%和 0.47%；其他行业指数均出现不同程度的下跌，石油石化、家电和非银金融行业跌幅靠前，跌幅超过了 15%，有 10 个行业指数的跌幅超过了 13%。

报告期间，本基金坚持坚持自下而上的选股思路，积极寻找优质标的，力争为持有人带来较好的业绩回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.160 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.31%，业绩比较基准收益率为-5.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况；本基金于 2020 年 1 月 2 日至 2020 年 3 月 31 日期间出现连续 58 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会报告并提出解决方案，本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§ 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	16,538,130.48	75.76
	其中：股票	16,538,130.48	75.76
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	5,094,727.10	23.34
8	其他资产	196,715.09	0.90
9	合计	21,829,572.67	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

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	11,507,220.48	56.68
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	414,645.00	2.04
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	4,616,265.00	22.74
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	-	-

0	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	16,538,130.48	81.46

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通投资股票。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	12,200	1,468,758.00	7.23
2	002460	赣锋锂业	36,400	1,465,100.00	7.22
3	002624	完美世界	14,000	665,700.00	3.28
4	300212	易华录	15,900	657,942.00	3.24
5	002555	三七互娱	18,900	617,274.00	3.04
6	002920	德赛西威	19,200	585,408.00	2.88
7	601689	拓普集团	35,700	580,482.00	2.86
8	002185	华天科技	58,200	573,852.00	2.83
9	603986	兆易创新	2,300	556,623.00	2.74
10	002373	千方科技	26,700	544,680.00	2.68

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,002.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	462.48
5	应收申购款	190,250.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	196,715.09

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,675,499.00
报告期期间基金总申购份额	23,584,097.74

减:报告期期间基金总赎回份额	8,759,898.51
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	17,499,698.23

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,878,908.13
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,878,908.13
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	10.74

7.2 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,本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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
机构	1	2020/1/1-2020/3/4	1,878,908.13	-	-	1,878,908.13	10.74%
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下,如该投资者集中赎回,可能会增加基金的流动性风险。此外,由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产,可能对持有资产的价格形成冲击,增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产,加强防范流动性风险、市场风险,保护持有人利益。</p>							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 关于申请募集注册新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

新沃基金管理有限公司

2020 年 4 月 22 日