

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金

2021 年第 2 季度报告

2021 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十日

§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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 19 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 2021 年 5 月 26 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合
基金主代码	012200
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 5 月 26 日
报告期末基金份额总额	786,362,756.09 份
投资目标	本基金通过合理的资产配置，精选科技主题的优质企业进行投资，在控制基金资产净值下行风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。
业绩比较基准	中证科技 100 指数收益率×60%+中债综合指数（总财富）收益率×30%+恒生指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平低于股票

	型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	012200	012201
报告期末下属分级基金的份额总额	560,428,512.62 份	225,934,243.47 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 5 月 26 日 (基金合同生效日) - 2021 年 6 月 30 日)	
	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A	新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C
	1. 本期已实现收益	-3,669,007.35
2. 本期利润	56,433,311.30	22,820,069.72
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1059	0.1035
4. 期末基金资产净值	617,824,170.62	248,954,114.40
5. 期末基金份额净值	1.1024	1.1019

注：1、本期已实现收益指本期利息收入、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、本基金自2021年5月26日成立，建仓期为6个月，截至报告期末本基金处于建仓期。

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

1、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A:

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
自基金合同 生效起至今	10.24%	1.44%	3.24%	0.71%	7.00%	0.73%

2、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C:

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
自基金合同 生效起至今	10.19%	1.44%	3.24%	0.71%	6.95%	0.73%

注：1、本基金自2021年5月26日成立，至2021年6月30日披露日未滿一年；

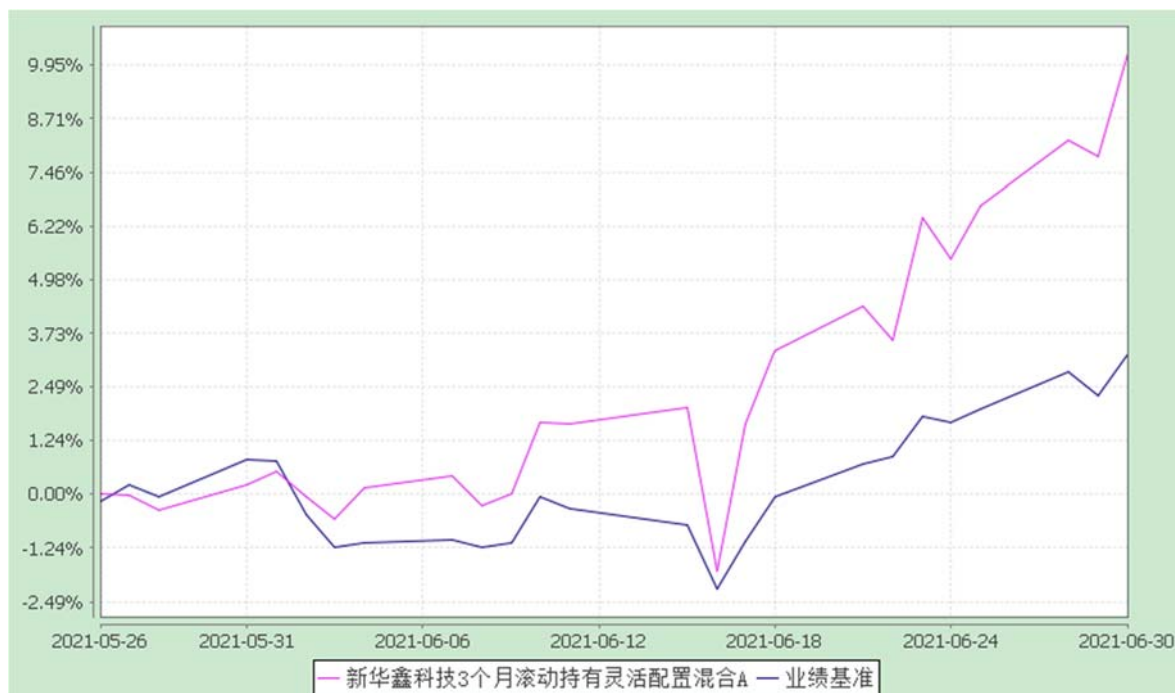
2、本基金建仓期为6个月，本报告期，本基金处于建仓期。

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

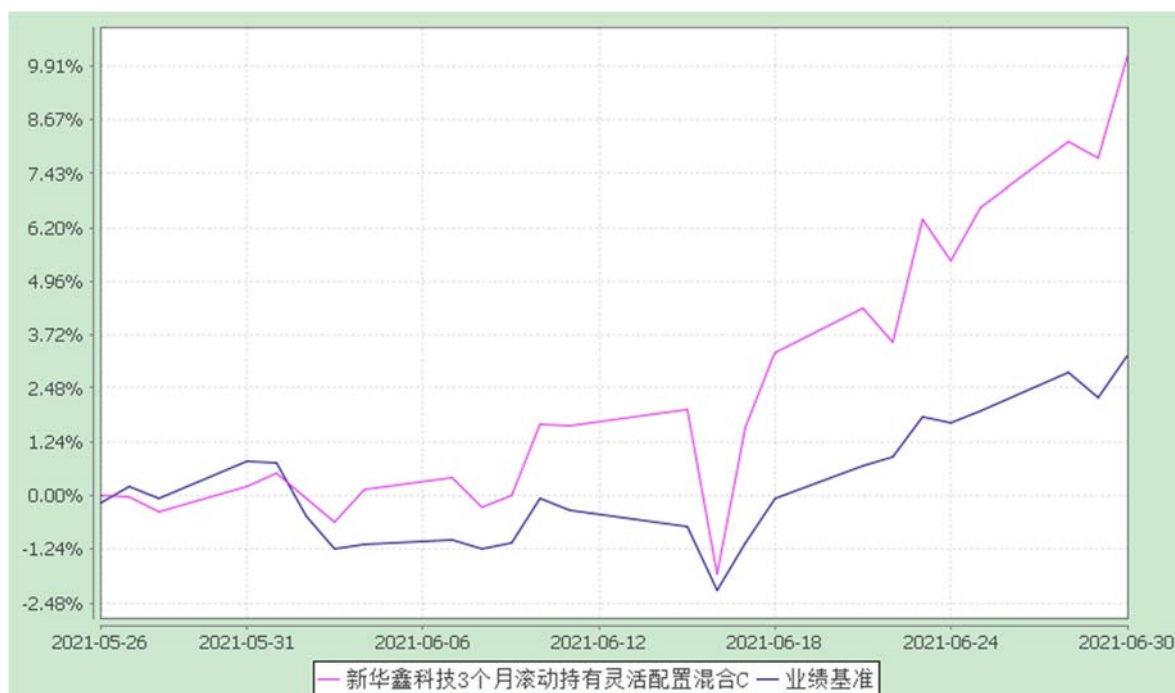
新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日)

1. 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A:



2. 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C:



注：1、本基金自 2021 年 5 月 26 日成立，至 2021 年 6 月 30 日披露日未满一年；

2、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		
付伟	本基金基金经理，新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选消费混合型证券投资基金基金经理。	2021-05-26	-	10	西安交通大学工学硕士，北京大学工商管理硕士，历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理，新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与 TMT 组组长，先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。

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遵规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置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》、《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年二季度市场见底回升，周期、科技、消费均有所表现。本基金成立于 5 月 26 日，考

考虑到重点投资的科技板块基本面持续向好，估值经过近一年调整具有明显性价比，本基金进行了快速建仓，重点配置了科技板块盈利趋势较好、预期差显著、估值有提升空间的优质公司，到季末取得了 10.24% 的收益率，显著跑赢市场。

国内疫情基本得到控制，经济逐渐步入正轨，从中长期看，科技创新是推动中国经济健康发展的重要推力之一。科技领域细分行业众多，我们重点看好前沿科技相关领域的投资机会，包括 5G 应用、人工智能、自动驾驶、半导体、物联网、国产软件、光伏、电动汽车等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.1024 元，本报告期份额净值增长率为 10.24%，同期比较基准的增长率为 3.24%；本基金 C 类份额净值为 1.1019 元，本报告期份额净值增长率为 10.19%，同期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 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	800,730,675.07	92.23
	其中：股票	800,730,675.07	92.23
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融	-	-

	资产		
6	银行存款和结算备付金合计	65,429,680.49	7.54
7	其他各项资产	2,058,040.42	0.24
8	合计	868,218,395.98	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	575,420,550.51	66.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	17,939.46	0.00
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	73,394,173.00	8.47
J	金融业	15,830,187.00	1.83
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	664,686,884.80	76.68

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	68,603,248.63	7.91

消费者非必需品	40,422,571.21	4.66
电信服务	27,017,970.43	3.12
合计	136,043,790.27	15.69

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	002371	北方华创	128,700	35,698,806.00	4.12
2	002475	立讯精密	754,500	34,707,000.00	4.00
3	S00981	中芯国际	1,529,000	30,406,782.65	3.51
4	002241	歌尔股份	709,200	30,311,208.00	3.50
5	S00763	中兴通讯	1,437,600	29,007,806.54	3.35
6	603986	兆易创新	153,800	28,899,020.00	3.33
7	603501	韦尔股份	88,300	28,432,600.00	3.28
8	002230	科大讯飞	411,100	27,782,138.00	3.21
9	002415	海康威视	422,850	27,273,825.00	3.15
10	S00700	腾讯控股	55,600	27,017,970.43	3.12

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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

本基金基金合同无国债期货投资策略。

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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同无国债期货投资策略。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 (1) “韦尔股份”发行人上海韦尔半导体股份有限公司，因资产质押情况未及时在临时公告中披露，上海监管局对其采取出具警示函的监管措施。（《关于上海韦尔半导体股份有限公司采取出具警示函措施的决定》，沪证监决〔2021〕67号，2021年4月28日）。

(2) “科大讯飞”的发行人收到国家网信办 2021 年 5 月 1 日通报，对输入法、地图导航等常见类型公众大量使用的部分 App 的个人信息收集使用情况进行检测，发现搜狗输入法、讯飞输入法、百度输入法、QQ 输入法等 33 款应用违法违规收集使用个人信息。按照要求，相关 App 运营者于通报发布之日起 10 个工作日内完成整改，逾期未完成整改的将被处置。

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	223,107.20
4	应收利息	5,278.30
5	应收申购款	1,829,654.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,058,040.42

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 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不存在流通受限的情况。

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 开放式基金份额变动

单位:份

项目	新华鑫科技3个月滚动	新华鑫科技3个月滚动

	持有灵活配置混合A	持有灵活配置混合C
基金合同生效日基金份额总额	512,573,928.99	216,316,038.20
本报告期期初基金份额总额	512,573,928.99	216,316,038.20
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	47,854,583.63	9,618,205.27
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	560,428,512.62	225,934,243.47

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三)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
- (四)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (五)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (六)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (七)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》
- (八)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (九)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (十)基金托管人业务资格批件及营业执照

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二一年七月二十日