

# 新华安康多元收益一年持有期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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	新华安康多元收益一年持有期混合
基金主代码	010401
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 16 日
报告期末基金份额总额	1,175,979,487.67 份
投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间动态配置，在控制下行风险的前提下，力争实现长期稳健的投资回报。
投资策略	<p>本基金投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资业务的投资策略等。</p> <p>本基金将密切关注宏观经济运行状况，通过对国家财政和货币政策、资本市场资金环境、证券市场走势等因素的综合分析，判断未来一段时间各类资产的风险收益情况、相</p>

	对收益率，主动调整股票、债券和现金类资产在给定区间内的动态配置比例，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15% + 中债综合指数（财富）收益率×80%+金融机构人民币活期存款利率（税后）×5%	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	新华安康多元收益一年持有期混合 A	新华安康多元收益一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	010401	010402
报告期末下属分级基金的份额总额	1,051,709,136.10 份	124,270,351.57 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 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	新华安康多元收益一年持有期混合 A	新华安康多元收益一年持有期混合 C
1.本期已实现收益	14,992,242.71	1,669,206.29
2.本期利润	17,650,601.42	1,991,765.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0171	0.0161
4.期末基金资产净值	1,081,015,706.35	127,459,744.88
5.期末基金份额净值	1.0279	1.0257

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、本基金自2020年12月16日成立，至2021年6月30日披露日未满一年。

### 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

##### 1、新华安康多元收益一年持有期混合 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
过去三个月	1.69%	0.11%	1.54%	0.15%	0.15%	-0.04%
过去六个月	2.35%	0.14%	1.88%	0.20%	0.47%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	2.79%	0.14%	3.15%	0.20%	-0.36%	-0.06%

##### 2、新华安康多元收益一年持有期混合 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
过去三个月	1.59%	0.11%	1.54%	0.15%	0.05%	-0.04%
过去六个月	2.15%	0.14%	1.88%	0.20%	0.27%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	2.57%	0.14%	3.15%	0.20%	-0.58%	-0.06%

注：本基金自2020年12月16日成立，至2021年6月30日披露日未满一年；

#### 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

新华安康多元收益一年持有期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  
(2020年12月16日至2021年6月30日)

##### 1. 新华安康多元收益一年持有期混合 A：



2. 新华安康多元收益一年持有期混合 C:



注：1、本基金自 2020 年 12 月 16 日成立，至 2021 年 6 月 30 日披露日未满一年；

2、本报告期末本基金各项资产配置比例符合基金合同的约定。

## §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		
姚秋	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司总经理助理、平衡投资部总监、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理、新华聚利债券型证券投资基金	2020-12-16	-	11	经济学博士、注册金融分析师，历任中国建设银行北京分行投资银行部投资研究工作、中国工商银行资产管理部固定收益投资经理。

	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。

#### 4.1.1 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

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 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安康多元收益一年持有期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》、《新华安康多元收益一年持有期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，从宏观数据来看，经济增长动能变弱，同时基建等逆周期调节工具的实施力度也在减弱。在去年大量的一次性货币投放后，经济体内的剩余流动性仍然宽松，一方面，有色金属、黑金属以及能源类大宗商品均有较好表现。资源品的表现在很大程度上是市场对经济复苏的预期、在流动性的推动下完成的，这与 2016 年的情形很相似（当年的二、三季度表现为债券价格和商品齐涨）。但大宗商品的上涨幅度最终由供需双方决定，供给的收缩更多与疫情有关，需求的扩张与美联储的货币投放和美国财政部的“直升机撒钱”有关。二者都是暂时性因素，因此后面的持续性不一定会很强。短期内的走势难以预判，我们更多地将其作为一个外生变量来对待。另一方面，剩余流动性对金融市场仍然有助推作用。

经历了一季度的市场调整，二季度股票市场和债券市场表现均较好。较为充裕的流动性叠加已经有所修复的估值水平，使得部分增量资金敢于入场。二季度，我们整体上维持股票的持仓水平和债券的久期水平，没有对总敞口进行明显调节。股票方面，我们根据观察池中标的的估值水平变化的对比情况，适度进行了持仓结构调整。减配的标的主要集中在非银金融、家电、医药等行业，增配的标的主要集中在化工、地产等短期热度不高的行业。整体持仓结构中，行业配置力度上较为均匀。债券方面，我们维持中短久期，以票息策略为主，坚持高等级无瑕疵的选债标准；我们维持一定比例的债性转债的持仓水平，其中主要以银行转债为主。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，新华安康多元 A 份额净值为 1.0279 元，本报告期份额净值增长率为 1.69%，同期比较基准的增长率为 1.54%；新华安康多元 C 份额净值为 1.0257 元，本报告期份额净值增长率为 1.59%，同期比较基准的增长率为 1.54%。

#### 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	136,170,557.04	11.18
	其中：股票	136,170,557.04	11.18
2	固定收益投资	1,047,257,983.85	85.97
	其中：债券	1,047,257,983.85	85.97
	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	15,270,615.21	1.25
7	其他各项资产	19,505,195.41	1.60
8	合计	1,218,204,351.51	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	4,029,000.00	0.33
C	制造业	72,120,846.12	5.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,109,020.39	0.26
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	1,443,350.22	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	4,671,800.00	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,022,877.64	0.50

J	金融业	15,263,697.10	1.26
K	房地产业	13,652,261.84	1.13
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,873,180.50	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	16,861.58	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,715,100.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	4,215,900.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	136,170,557.04	11.27

### 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股票。

### 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	300059	东方财富	204,000	6,689,160.00	0.55
2	600519	贵州茅台	3,000	6,170,100.00	0.51
3	600750	江中药业	420,000	5,565,000.00	0.46
4	601799	星宇股份	23,800	5,372,136.00	0.44
5	600690	海尔智家	191,000	4,948,810.00	0.41
6	002242	九阳股份	150,500	4,889,745.00	0.40
7	603589	口子窖	72,000	4,873,680.00	0.40
8	601318	中国平安	75,000	4,821,000.00	0.40
9	601006	大秦铁路	710,000	4,671,800.00	0.39
10	300416	苏试试验	185,000	4,236,500.00	0.35

#### 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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

1	国家债券	8,876,000.00	0.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	148,434,000.00	12.28
	其中：政策性金融债	138,369,000.00	11.45
4	企业债券	20,898,000.00	1.73
5	企业短期融资券	80,307,000.00	6.65
6	中期票据	769,369,000.00	63.66
7	可转债（可交换债）	19,373,983.85	1.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,047,257,983.85	86.66

#### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	101900397	19 中化工 MTN001	650,000	65,520,000.00	5.42
2	101769015	17 鲁国资 MTN001	500,000	51,525,000.00	4.26
3	101751004	17 中节能 MTN001	500,000	50,820,000.00	4.21
4	101900906	19 京津冀 MTN002	500,000	50,655,000.00	4.19
5	101900956	19 陕延油 MTN008	500,000	50,610,000.00	4.19

#### 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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

#### 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

本基金本报告期末无权证投资。

## 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

本基金在股值期货的投资中以套期保值为目的，主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

## 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

本基金在国债期货的投资中以套期保值为目的，综合利用对冲策略和套利策略，实现降低组合波动和增加组合收益的目标。对冲策略主要包括套期保值和久期调整，国债期货具有高杠杆、高流动性、可做空等优势，通过运用国债期货对冲可以降低债券持仓风险从而降低业绩波动，另外通过国债期货也可以来调节组合久期实现低成本调仓的目标。套利策略则通过利用国债期货与基差的交易性机会来拓宽组合盈利模式从而提高组合投资业绩。

### 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。

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	64,644.25
2	应收证券清算款	604,348.14
3	应收股利	-

4	应收利息	18,290,846.69
5	应收申购款	545,356.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,505,195.41

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	11,050,148.40	0.91

#### 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

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	新华安康多元收益一年 持有期混合A	新华安康多元收益一年 持有期混合C
本报告期期初基金份额总额	1,020,079,105.71	123,377,300.39
报告期期间基金总申购份额	31,630,030.39	893,051.18
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,051,709,136.10	124,270,351.57

## §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

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期末有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) 中国证监会批准新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 《新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《新华安康多元收益一年持有期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) 《新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》(更新)
- (七) 《新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金产品资料概要》(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
- (十) 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

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 9.3 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