

新华钻石品质企业混合型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华钻石品质企业混合
基金主代码	519093
交易代码	519093
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 2 月 3 日
报告期末基金份额总额	55,204,270.90 份
投资目标	本基金通过对上市公司基本面的深入研究，结合宏观经济周期和行业景气度分析，力求在有效控制风险并适度保持良好流动性的前提下，精选具有稳定价值性和高质量成长性的钻石品质类的优质上市公司。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略，通过对经济周期、行业特征等宏观层面的信息进行全面分析，调整大类资产配置比例和行业配置比例；在个股个券的选

	择上采用自下而上的投资策略，核心是从企业价值的稳定性和成长的高质量出发，筛选具有钻石品质的优质企业，并进行重点配置。钻石品质企业股票的配置比例不低于股票资产配置的 80%。钻石品质企业是指具有稳定价值性和高质量成长性的上市公司，它们具有安全、透明、稳定、创新与领导气质五大优秀品质。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率
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。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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
	(2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-6,810,439.76
2.本期利润	-34,774,372.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6214
4.期末基金资产净值	176,668,659.59
5.期末基金份额净值	3.2003

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。

3.2 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	-16.28%	1.50%	-5.17%	0.96%	-11.11%	0.54%
过去六个月	-13.55%	1.27%	-2.33%	0.88%	-11.22%	0.39%
过去一年	-4.41%	1.40%	5.88%	0.97%	-10.29%	0.43%
过去三年	87.81%	1.43%	36.91%	1.08%	50.90%	0.35%
过去五年	68.79%	1.27%	44.87%	0.96%	23.92%	0.31%
自基金合同生效起至今	220.03%	1.42%	62.22%	1.15%	157.81%	0.27%

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

新华钻石品质企业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历史走势对比图
 (2010 年 2 月 3 日至 2021 年 9 月 30 日)



注：报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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		
蔡春红	本基金基金经理, 新华稳健回报灵活配置混合型发起式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。	2017-01-06	-	11	国际金融硕士, 历任新华基金管理股份有限公司研究部行业研究员, 基金经理助理。

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钻石品质企业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》、《新华钻石品质企业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段时间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 年三季度，伴随周期产品价格上行，周期股中报业绩超预期的刺激下，水泥、钢铁、煤炭等周期板块涨幅显著，消费、科技等板块窄幅震荡。在限电等政策的影响下，中游部分行业开工不足，进一步推升了产品价格的抬升。在产品价格链传导带来的终端价格提升以及经济环比弱化带来的需求疲软等双重影响下，终端消费需求较差。8-9 月消费数据在高基数以及需求不佳等多重因素影响下，呈现个位数的增长。考虑到四季度高基数效应的减弱以及春节旺季来临，三季度有望成为多数消费品公司的业绩拐点，后续将呈现逐渐改善态势。

报告期内，本基金仓位保持较高水平。配置方面，依旧聚焦于优质消费行业龙头和细分赛道龙头公司。细分行业中，以估值相对合理以及基本面持续改善的消费和医药行业为主，如白酒、食品、轻工制造等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 3.2003 元，本报告期份额净值增长率为 -16.28%，同期比较基准的增长率为-5.17%。

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	166,589,519.34	91.16
	其中：股票	166,589,519.34	91.16
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	15,058,940.56	8.24
7	其他各项资产	1,104,545.51	0.60
8	合计	182,753,005.41	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	18,116.82	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	128,516,246.11	72.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,183.39	0.01
F	批发和零售业	18,400.20	0.01
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	5,348,984.28	3.03
J	金融业	14,452,750.00	8.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,780,000.00	7.80
M	科学研究和技术服务业	4,398,743.64	2.49
N	水利、环境和公共设施管理业	27,142.28	0.02
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	8,952.62	0.01
S	综合	-	-
	合计	166,589,519.34	94.29

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 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	601888	中国中免	53,000	13,780,000.00	7.80

2	603899	晨光文具	173,000	11,760,540.00	6.66
3	600036	招商银行	175,000	8,828,750.00	5.00
4	600779	水井坊	63,000	8,010,450.00	4.53
5	600702	舍得酒业	37,000	7,636,800.00	4.32
6	603195	公牛集团	43,000	7,019,750.00	3.97
7	605499	东鹏饮料	33,000	6,659,400.00	3.77
8	300132	青松股份	471,300	6,598,200.00	3.73
9	688677	海泰新光	58,000	6,351,000.00	3.59
10	603027	千禾味业	320,000	6,288,000.00	3.56

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

本报告期末本基金无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金尚无股指期货投资政策。

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

本报告期末本基金尚无国债期货投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 (1) “招商银行”发行人招商银行股份有限公司，因违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财资金池化运作等违规行为，中国银保监会依据《中华人民共和国银行业监督管理法》对该行罚款 7170 万元。（银保监罚决字（2021）16 号，2021 年 5 月 17 日）。

(2) “舍得酒业”发行人舍得酒业股份有限公司于 2020 年 10 月 30 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（编号：成稽调查字 2020023 号），因公司涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对司进公行立案调查。

(3) “公牛集团”的发行人公牛集团股份有限公司于 2021 年 5 月 12 日收到浙江省市场监督管理局垄断案件立案调查。

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	79,221.09
2	应收证券清算款	980,506.01
3	应收股利	-
4	应收利息	1,729.22
5	应收申购款	43,089.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,104,545.51

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

本报告期初基金份额总额	57,950,623.32
报告期期间基金总申购份额	1,870,042.62
减：报告期期间基金总赎回份额	4,616,395.04
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	55,204,270.90

§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

本基金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钻石品质企业混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华钻石品质企业混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 《新华钻石品质企业混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《新华钻石品质企业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) 更新的《新华钻石品质企业混合型证券投资基金招募说明书》
- (七) 《新华钻石品质企业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

二〇二一年十月二十六日