

# 新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年第 2 季度报告

2023 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十一日

## §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 2023 年 7 月 20 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	新华鑫利灵活配置混合
基金主代码	519165
交易代码	519165
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2014 年 4 月 23 日
报告期末基金份额总额	3,516,544.21 份
投资目标	通过积极的选股和资产配置策略，在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续增长，并力争为投资者提供稳定的绝对回报。
投资策略	投资策略方面，本基金将以大类资产配置策略为基础，采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率 +50%×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风险中

	等预期收益品种，预期风险和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
	(2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-87,879.54
2.本期利润	-63,240.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0179
4.期末基金资产净值	4,787,697.22
5.期末基金份额净值	1.3615

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。

#### 3.2 基金净值表现

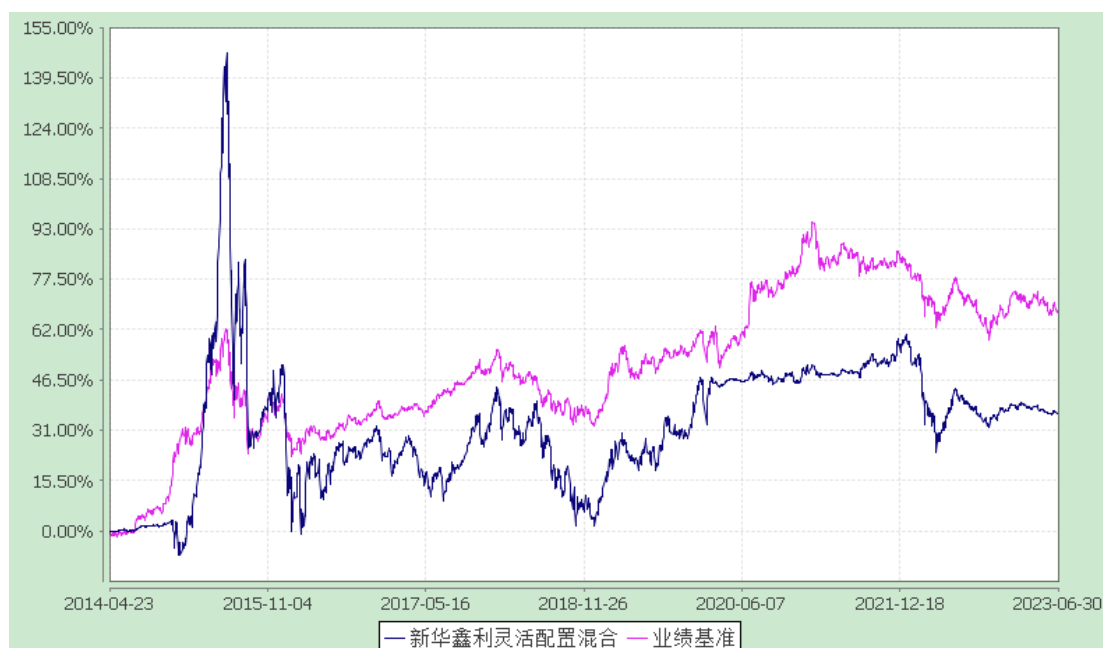
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.30%	0.15%	-1.87%	0.41%	0.57%	-0.26%
过去六个月	-0.69%	0.21%	0.79%	0.42%	-1.48%	-0.21%
过去一年	-5.44%	0.32%	-5.44%	0.49%	0.00%	-0.17%

过去三年	-7.19%	0.58%	2.62%	0.60%	-9.81%	-0.02%
过去五年	4.89%	0.86%	18.75%	0.64%	-13.86%	0.22%
自基金合同生效起至今	36.15%	1.38%	68.01%	0.71%	-31.86%	0.67%

### 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

新华鑫利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历史走势对比图  
(2014 年 4 月 23 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：本报告期，本基金各项资产配置比例符合本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		
曹巍浩	本基金基金经理, 新	2021-05-19	-	16	学士, 历任德意志交易所集团数据与分析部 MNI 中国金融市场分析师, 汤森路透

	华鼎利债券型证券投资基金基金经理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理。				中国债券和货币市场高级分析师，天风证券固收执行总经理和账户投资经理，新华基金管理股份有限公司固定收益研究部总监。
--	---	--	--	--	--

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》、《基金从业人员管理规则》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鑫利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》、《新华鑫利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办法》，以避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。该办法规范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。

公司通过合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，使各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”作为交易执行的公平原则，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。

本报告期内，公平交易管理执行情况良好。

#### 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

2023 年二季度，需求修复节奏不及市场预期，供求关系下价格信号偏弱，市场风险偏好走低，整体避险资产表现好于风险资产。

债券市场方面，2023 年二季度，中债综合财富指数上涨 1.67%，利率债表现好于信用。中债固息利率债总财富指数上涨 1.87%，中债信用债总财富指数则上涨 1.24%。杠杆策略仍稳定的情况下，久期策略体现出其相对优势。

偏权益市场方面，万得全 A 指数下跌 3.20%，沪深 300 指数下跌 5.15%，中证 1000 指数下跌 3.98%。转债表现好于正股，中证转债指数微跌 0.15%。

本基金立足股债轮动。组合二季度具体看，债券投资方面，以利率债管理组合流动性。股票投资方面，多数时间仓位不高，在标的风险收益率比改善后，精选标的，敞口有所增加。未来，本基金将继续注意股债仓位的切换以及持仓的风格，积极寻找配置机会，保证组合收益弹性。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3615 元，本报告期份额净值增长率为 -1.30%，同期比较基准的增长率为-1.87%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金从 2023 年 4 月 1 日到 2023 年 6 月 30 日连续 59 个工作日基金资产净值低于五千万元。

后续经营计划

我司将通过多方面的措施促进本基金的规模增长，具体经营计划如下：

（一）与主要销售机构合作制定销售计划，以重点地区为主，将公司的资源向重点地区倾斜。

（二）进一步加强与潜在销售机构的合作，拓宽渠道和客户资源。

（三）采用新客户开发与老客户深入挖掘并重的客户开发方式。

（四）加强投资者教育，引导投资者充分认识产品的风险收益特点。综上所述，本基金为我司产品线主要组成部分。受市场环境的影响，本基金规模出现缩减。我司将在做好基金日常投资运营的同时，加大持续营销工作投入，同时探索其他方式和手段，尽力提升基金规模。

## §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	1,156,526.64	21.98
	其中：股票	1,156,526.64	21.98
2	固定收益投资	401,362.79	7.63
	其中：债券	401,362.79	7.63

	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	1,600,177.75	30.41
	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	2,103,325.35	39.97
7	其他各项资产	516.93	0.01
8	合计	5,261,909.46	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	843,272.64	17.61
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	93,401.00	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	58,840.00	1.23
K	房地产业	91,210.00	1.91
L	租赁和商务服务业	39,498.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	30,305.00	0.63
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	1,156,526.64	24.16

### 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。

### 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	000157	中联重科	30,000	202,500.00	4.23
2	001979	招商蛇口	7,000	91,210.00	1.91
3	600309	万华化学	1,000	87,840.00	1.83
4	000651	格力电器	2,400	87,624.00	1.83
5	603517	绝味食品	2,200	81,730.00	1.71
6	002075	沙钢股份	20,000	80,200.00	1.68
7	600115	中国东航	16,000	76,160.00	1.59
8	688617	惠泰医疗	200	74,750.00	1.56
9	603345	安井食品	500	73,400.00	1.53
10	000776	广发证券	4,000	58,840.00	1.23

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	401,362.79	8.38
	其中：政策性金融债	401,362.79	8.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	401,362.79	8.38

### 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	018008	国开 1802	3,870	401,362.79	8.38

### 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

本基金合同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

本基金合同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

本基金报告期无国债期货投资。

## 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是否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

1、“绝味食品”的发行人绝味食品股份有限公司，因为未及时披露股权投资转让协议、未披露关联方共同投资、未按规定披露关联方及关联交易、经营性占用公司门店营业款、加盟费、管理费，被湖南证监局于 2023 年 4 月 26 日处以行政处罚。【行政监管措施决定书(2023)19 号】

2、“广发证券”的发行人广发证券股份有限公司于 4 月 17 日收到中国证监会《立案告知书》，因公司在美尚生态景观股份有限公司 2018 年非公开发行股票的保荐业务中未勤勉尽责，涉嫌违法，中国证监会决定对公司立案。

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	516.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	516.93

#### 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

本报告期期初基金份额总额	3,545,560.38
报告期期间基金总申购份额	3,689.28
减：报告期期间基金总赎回份额	32,705.45
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,516,544.21

### §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

本基金本报告期未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) 中国证监会核准新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 更新的《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (五) 《新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》(更新)
- (六) 关于申请募集新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (八) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (九) 中国证监会要求的其他文件
- (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,或通过基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二三年七月二十一日