

# 新沃创新领航混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十八日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料经审计，上会会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	11
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容 .....	18
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表 .....	21
7.2 利润表 .....	22
7.3 净资产变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
8.6 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.....	56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	56

8.8	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贵金属投资明细	56
8.9	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	56
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	56
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12	投资组合报告附注	56
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>58</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	58
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>59</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>60</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	60
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4	基金投资策略的改变	60
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8	其他重大事件	61
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>63</b>
12.1	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	63
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	63
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>64</b>
13.1	备查文件目录	64
13.2	存放地点	64
13.3	查阅方式	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新沃创新领航混合型证券投资基金	
基金简称	新沃创新领航混合	
基金主代码	010570	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 24 日	
基金管理人	新沃基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	90,378,553.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	新沃创新领航混合 A	新沃创新领航混合 C
下属分级基金的交易代码:	010570	010571
报告期末下属分级基金的份额总额	25,865,281.40 份	64,513,272.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于创新领航主题的股票，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，本基金通过优选个股，进行积极的组合优化，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要通过国内外宏观经济运行状况、财政和货币政策、产业政策环境以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间各类资产相对收益率的基础上，动态优化调整国内依法发行上市的股票、债券、现金等大类资产的配置。本基金非现金基金资产的 80%需投资于创新领航主题的股票。本基金所指的“创新领航”主题涵盖了把创新发展作为应对环境变化、增强发展动力、把握主动权的发展之策，实现关键核心技术自主可控、推动产品和产业向价值链中高端跃升、甚至引领行业发展新方向的优质上市企业。 其他主要投资策略还包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略、存托凭证投资策略和融资业务投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	新沃基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王靖飞
	联系电话	400-698-9988
	电子邮箱	service@sinvofund.com
客户服务电话	400-698-9988	0574-83895886
传真	010-58290555	0574-89103213

注册地址	山东省青岛市崂山区苗岭路 15 号青岛金融中心大厦 702 室	浙江省宁波市鄞州区东路 345 号
办公地址	北京市朝阳区安贞西里五区 1 号楼新华金融大厦 5 层 519 室	浙江省宁波市鄞州区东路 345 号
邮政编码	100029	315100
法定代表人	朱灿	陆华裕

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.sinvofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼
注册登记机构	新沃基金管理有限公司	北京市朝阳区安贞西里五区 1 号楼新华金融大厦 5 层 519 室

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	新沃创新领航混合 A	新沃创新领航混合 C	新沃创新领航混合 A	新沃创新领航混合 C	新沃创新领航混合 A	新沃创新领航混合 C
本期已实现收益	-3,250,824.81	-7,866,623.75	-3,112,833.35	-6,789,768.30	7,662,120.80	10,356,376.92
本期利润	-3,306,843.11	-8,674,923.79	-10,960,297.62	-20,864,465.03	9,402,849.35	21,249,029.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1231	-0.1339	-0.3683	-0.3475	0.1860	0.1600
本期加权平均净值利润率	-16.37%	-18.10%	-39.61%	-37.83%	17.93%	15.83%
本期基金份额净值增长率	-16.95%	-17.37%	-31.94%	-32.27%	16.15%	15.56%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-8,884,037.00	-22,794,943.32	-6,271,577.86	-14,161,925.26	4,810,400.11	7,486,492.90
期末可供分配基金份额利润	-0.3435	-0.3533	-0.2095	-0.2174	0.1615	0.1555
期末基金资产净值	16,981,244.40	41,718,328.68	23,668,502.39	50,967,798.65	34,599,053.39	55,622,132.41
期末基金份额净值	0.6565	0.6467	0.7905	0.7826	1.1615	1.1555
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-34.35%	-35.33%	-20.95%	-21.74%	16.15%	15.55%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、本报告所列示的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、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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

新沃创新领航混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.26%	1.67%	-4.54%	0.55%	5.80%	1.12%
过去六个月	-17.71%	1.74%	-6.97%	0.59%	-10.74%	1.15%
过去一年	-16.95%	1.74%	-6.63%	0.59%	-10.32%	1.15%
过去三年	-34.35%	1.71%	-21.63%	0.78%	-12.72%	0.93%
自基金合同生效起至今	-34.35%	1.70%	-19.34%	0.78%	-15.01%	0.92%

新沃创新领航混合 C

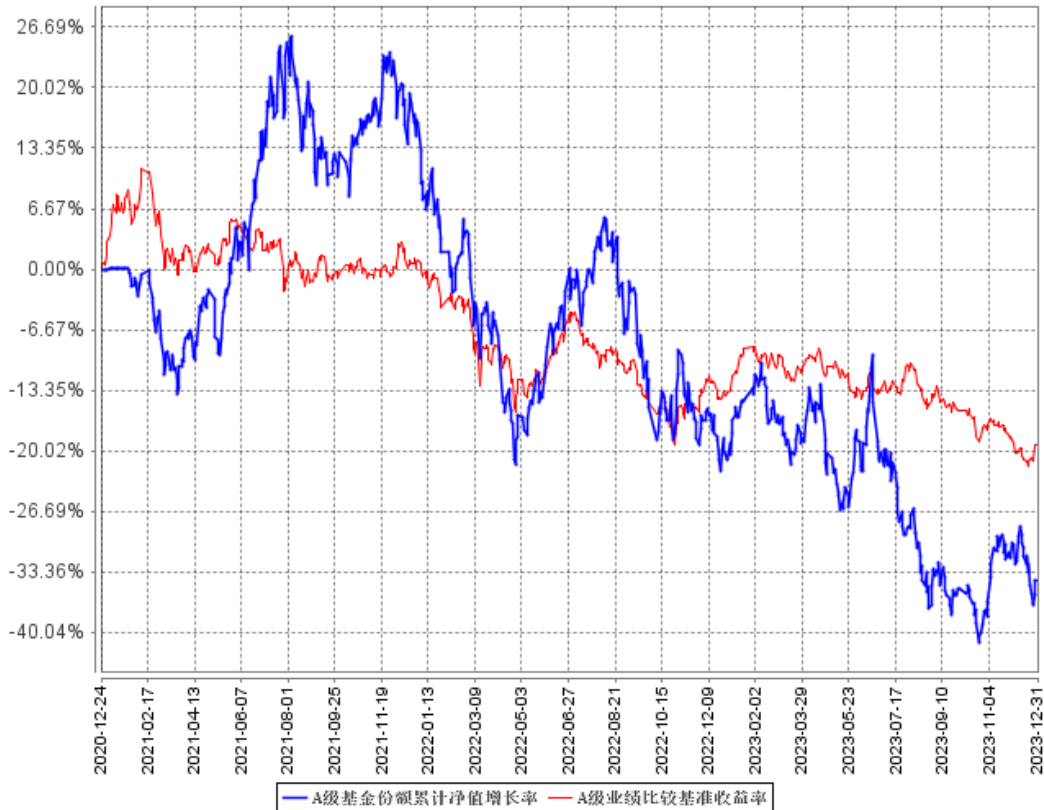
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.16%	1.67%	-4.54%	0.55%	5.70%	1.12%
过去六个月	-17.91%	1.74%	-6.97%	0.59%	-10.94%	1.15%
过去一年	-17.37%	1.74%	-6.63%	0.59%	-10.74%	1.15%
过去三年	-35.32%	1.71%	-21.63%	0.78%	-13.69%	0.93%
自基金合同生效起至今	-35.33%	1.70%	-19.34%	0.78%	-15.99%	0.92%

注：本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则，本基金选取“沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%”作为本基金的比较基准。

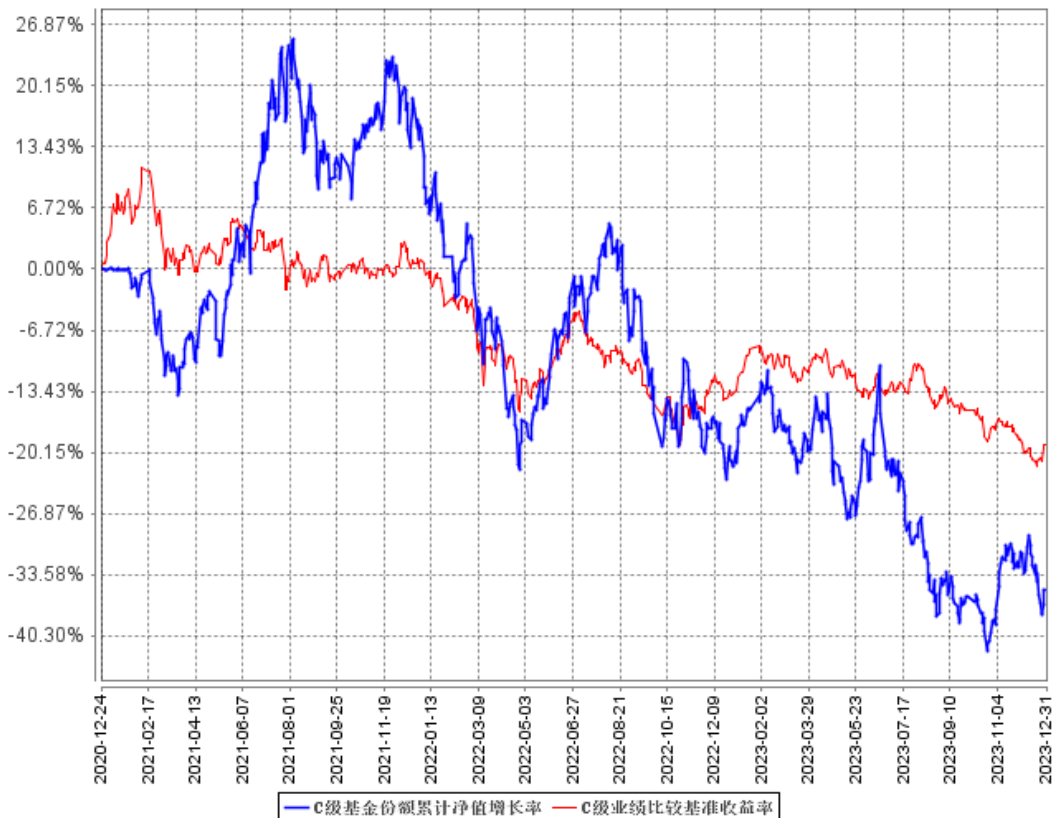


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级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

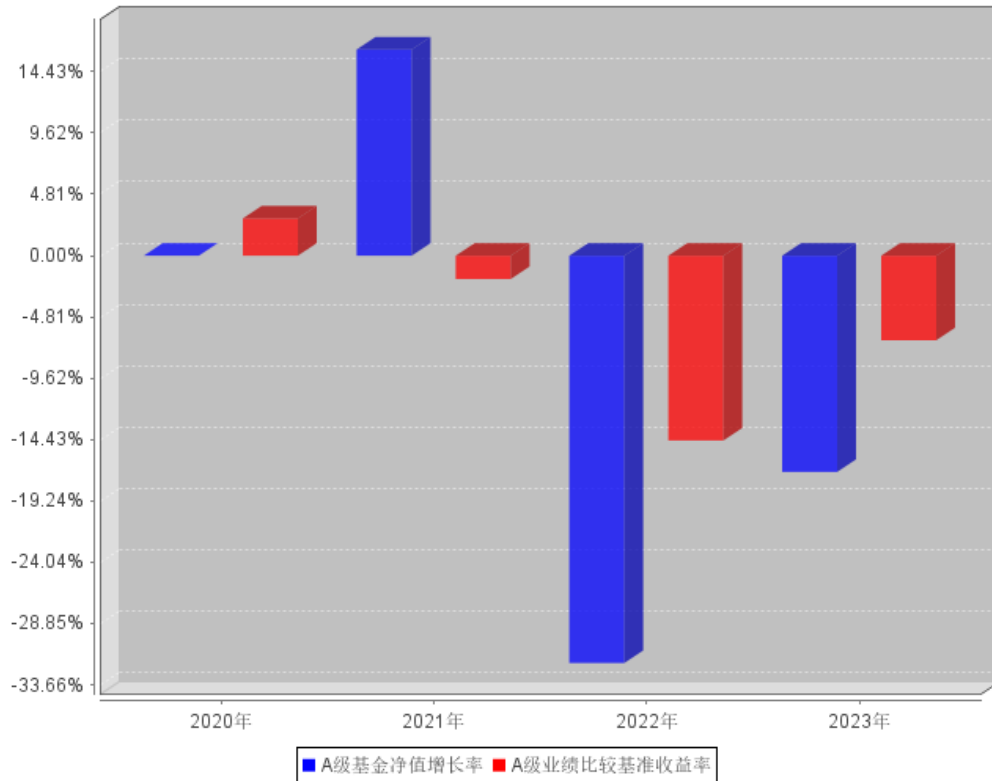


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

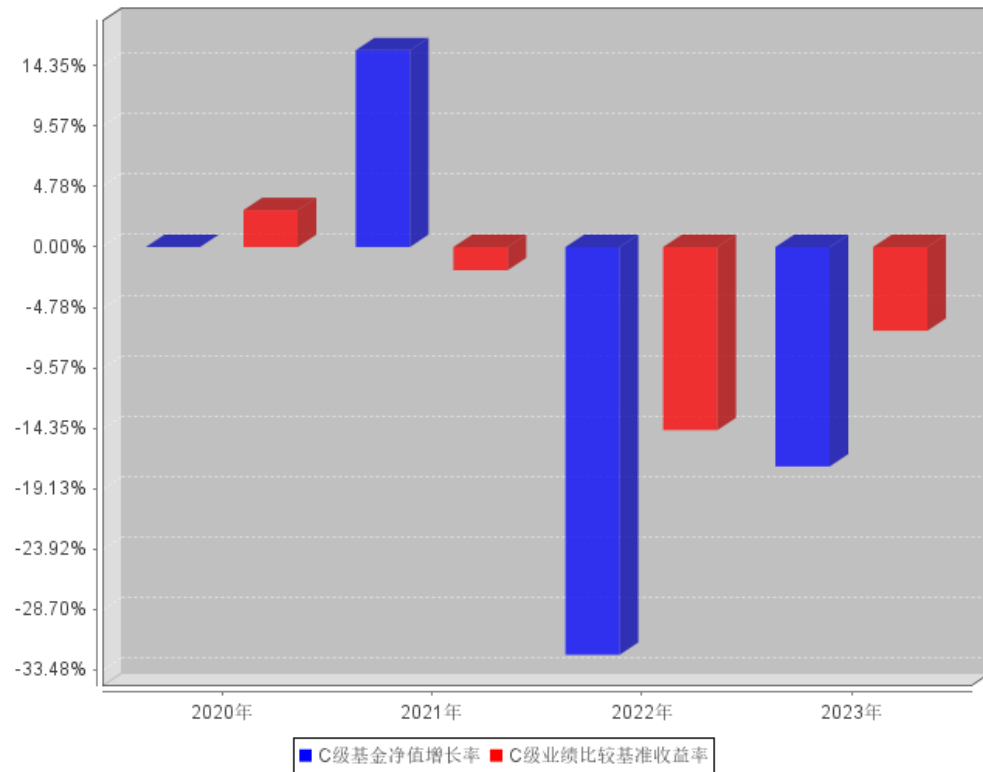


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2020 年 12 月 24 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然

年度进行折算。

### **3.3 过去三年基金的利润分配情况**

本基金于 2020 年 12 月 24 日生效，未进行过利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新沃基金管理有限公司成立于 2015 年 8 月，是一家经中国证监会核准设立的全国性基金管理公司，经营范围包括公募基金管理业务、证券投资基金销售业务和中国证监会许可的其他业务。截至 2023 年 12 月 31 日，公司共管理 6 只公募基金，分别是新沃通宝货币市场基金、新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金、新沃通利纯债债券型证券投资基金、新沃创新领航混合型证券投资基金、新沃内需增长混合型证券投资基金、新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金。

未来，公司将继续秉承“专业创造价值，合作实现价值”的发展理念，坚持“以人为本”的发展战略，坚守“诚信、专业、合作、超越”的价值准则，致力于经过长期努力跻身国内一流基金管理公司行列，力求为广大投资者提供稳定的投资回报。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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、公司副总经理兼投资总监	2020年12月24日	-	16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，先后担任研究部总监、总经理助理。现担任公司副总经理兼投资总监、基金经理。
刘腾飞	本基金的	2021年12月	-	5年	重庆大学金融学硕

	基金经理	14 日			士, 中国籍。2016 年 7 月起在新沃控股集团有限公司投资管理部担任投资经理。2018 年 9 月加入新沃基金管理有限公司, 历任投资研究部研究员、投资经理, 现担任基金经理。
--	------	------	--	--	--

注: 1、对基金的首任基金经理, 其“任职日期”按基金合同生效日填写, “离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期, 对此后的非首任基金经理, “任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.3 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

本报告期末基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益。本报告期内, 本基金运作整体合法合规, 没有损害基金持有人利益。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《新沃基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系, 加强交易分配环节的内部控制, 并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时, 通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证对公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 完善相应制度及流程, 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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司制定了《异常交易监控管理办法》对各类异常交易的情形进行了界定，并制定相应的监控方法与识别、报告、处理程序。

本报告期内，公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发生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交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年是中国经济疫情管控放开后的第一年，经济运行整体呈现前低中高后稳态势，GDP 全年同比增长 5.2%，四个季度分别为 4.5%、6.3%、4.9% 和 5.2%。2023 年，国内经济延续了新旧经济动能转换的特征，房地产投资增速同比下滑的同时，以新能源和人工智能为代表的高端制造业取得了较快的发展。但是，房地产投资下行压力以及地方政府债务偿还压力仍待解决。外围环境方面，世界经济和政治局势依然动荡，俄乌战争和巴以冲突仍未结束，美国联合盟友对中国高科技行业的堵截和打压并未停止。

在全球主要股票市场继续牛市的情况下，A 股市场 2023 年上半年在人工智能板块的带领下曾有过一波波澜壮阔的结构性行情，之后随着 AI 板块的暴跌，市场整体也继续震荡下行。报告期内，主要指数均连续第二年收跌，其中创业板指数跌幅最大，全年跌幅 19.41%；中小 100 指数下跌 17.98%，深成指跌幅也高达 13.54%。上证综指虽然跌幅只有 3.7%，但代表蓝筹白马的权重指数上证 50 全年跌幅 11.73%。行业指数方面，中信一级行业中通信、传媒和煤炭行业涨幅靠前，涨幅分别达到 24.78%、19.84% 和 13.39%；消费者服务、房地产和电力设备及新能源行业跌幅靠前，跌幅分别高达 41.18%、24.8% 和 24.65%。

报告期间，本基金坚持自下而上的选股思路，积极寻找优质标的，力争获取较高的收益。我们在控制风险的基础上，本年度继续重点配置了游戏、数字经济、智能驾驶、芯片半导体等四大板块，同时关注人工智能、VR、军工等潜在的高景气度板块，并积极寻找具有超额收益的行业及个股，力争为持有人带来较好的业绩回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末新沃创新领航混合 A 基金份额净值为 0.6565 元，本报告期基金份额净值增长率为 -16.95%；截至本报告期末新沃创新领航混合 C 基金份额净值为 0.6467 元，本报告期基金份额净值增长率为 -17.37%；同期业绩比较基准收益率为 -6.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，我们认为在财政政策和货币政策的双重发力下，中国经济将是继续温和复苏的一年。房地产投资将迎来新动能，“三大工程”建设接力，缓和房地产投资疲软局面，有效实现房地产行业的软着陆。通过特别国债以及借新还旧的方式，地方政府债务问题也将得到较好的控制和解决。另外，我们预计美联储将在 2024 年下半年进入降息周期，这也将缓解人民币汇率贬值的压力，给国内货币政策腾出更多的操作空间。

在国内经济继续复苏以及美联储将进入降息周期的预期之下，我们认为已经在熊市中运行 2 年的 A 股有望在 2024 年取得不错的表现。我们认为 2024 年将是 A 股终结熊市，并为未来牛市夯实基础的一年，指数的向上空间可能不大，但结构性的行情会出现。基于行业景气度角度，我们继续看好人工智能、芯片半导体、智能驾驶和机器人板块的投资机会，同时我们也看好以光伏和锂电为代表的股价下跌充分但基本面也已经见底，未来行业基本面有潜在向上改善预期的行业。

未来，我们将依然严格恪守投资边界，采取自下而上为主，自上而下为辅的选股策略，继续长期致力于挖掘业绩快速增长且估值合理的公司。我们将继续重点投资和配置游戏、数字经济、智能驾驶、芯片半导体等四大板块，同时将根据各行业新的景气度状况，对组合进行部分调整，继续力争为持有人带来较好的业绩回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强法律合规风险管理和监察稽核工作。基金管理人积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，进一步完善公司的内部制度及流程，促进公司各项业务合法合规；组织了多项合规及业务培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设；针对销售、投资研究等重点业务，加大内部检查力度，确保基金运作的稳健合规；对基金的宣传推介、投资交易、运营、IT 等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，避免违规行为的发生。

本报告期内本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提升监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，为建立健全有效的估值政策和程序，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由投资研究部、监察稽核部、基金事务部相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究

和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

(3) 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

(4) 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在新沃创新领航混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字(2024)第 1534 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	新沃创新领航混合型证券投资基金全体份额持有人
审计意见	<p>我们审计了新沃创新领航混合型证券投资基金(以下简称“新沃创新领航混合”)财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附新沃创新领航混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《新沃创新领航混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了新沃创新领航混合 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于新沃创新领航混合,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系新沃创新领航混合管理人(以下简称“管理人”)根据《新沃创新领航混合型证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的,因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供新沃创新领航混合份额持有人和向中国证券投资基金业协会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。</p>
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括新沃创新领航混合 2023 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《新沃创新领航混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理人负责评估新沃创新领航混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</li> <li>2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</li> <li>3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</li> <li>4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对新沃创新领航混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中</li> </ol>

	<p>提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致新沃创新领航混合不能持续经营。</p> <p>5、评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理人就新沃创新领航混合的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈大愚   江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：新沃创新领航混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	3,365,737.22	5,142,773.31
结算备付金		1,016.84	1,001.52
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	55,498,489.68	69,831,104.38
其中：股票投资		55,498,489.68	69,831,104.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		51,642.36	150,453.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		58,916,886.10	75,125,333.07
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		17,098.77	246,591.54

应付管理人报酬		62,062.41	98,209.92
应付托管费		7,757.78	9,820.97
应付销售服务费		18,393.89	22,406.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	112,000.17	112,003.42
负债合计		217,313.02	489,032.03
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	90,378,553.40	95,069,804.16
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-31,678,980.32	-20,433,503.12
净资产合计		58,699,573.08	74,636,301.04
负债和净资产总计		58,916,886.10	75,125,333.07

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，新沃创新领航混合 A 基金份额净值 0.6565 元，基金份额总额 25,865,281.40 份；新沃创新领航混合 C 基金份额净值 0.6467 元，基金份额总额 64,513,272.00 份。新沃创新领航混合份额总额合计为 90,378,553.40 份。

## 7.2 利润表

会计主体：新沃创新领航混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-10,563,208.05	-30,072,724.85
1.利息收入		13,340.20	31,582.99
其中：存款利息收入	7.4.7.13	13,340.20	31,582.99
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,752,859.83	-8,240,911.96
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-10,074,327.94	-8,559,321.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	321,468.11	318,409.64

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-864,318.34	-21,922,161.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	40,629.92	58,765.12
<b>减：二、营业总支出</b>		1,418,558.85	1,752,037.80
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	963,812.98	1,240,824.44
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	102,490.79	124,082.45
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	240,255.08	275,130.91
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	112,000.00	112,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-11,981,766.90	-31,824,762.65
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-11,981,766.90	-31,824,762.65
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-11,981,766.90	-31,824,762.65

### 7.3 净资产变动表

会计主体：新沃创新领航混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	95,069,804.16	-	-20,433,503.12	74,636,301.04
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	95,069,804.16	-	-20,433,503.12	74,636,301.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,691,250.76	-	-11,245,477.20	-15,936,727.96
（一）、综合收益总额	-	-	-11,981,766.90	-11,981,766.90
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-4,691,250.76	-	736,289.70	-3,954,961.06
其中：1.基金申购款	30,826,329.91	-	-7,784,697.60	23,041,632.31
2.基金赎回款	-35,517,580.67	-	8,520,987.30	-26,996,593.37
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	90,378,553.40	-	-31,678,980.32	58,699,573.08
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	77,924,292.79	-	12,296,893.01	90,221,185.80
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	77,924,292.79	-	12,296,893.01	90,221,185.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	17,145,511.37	-	-32,730,396.13	-15,584,884.76
（一）、综合收益总额	-	-	-31,824,762.65	-31,824,762.65
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产	17,145,511.37	-	-905,633.48	16,239,877.89



减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	53,723,222.37	-	-2,852,604.41	50,870,617.96
2.基金赎回款	-36,577,711.00	-	1,946,970.93	-34,630,740.07
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	95,069,804.16	-	-20,433,503.12	74,636,301.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 李钧 _____	_____ 李钧 _____	_____ 孙娟 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

新沃创新领航混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可第[2020]2712号《关于准予新沃创新领航混合型证券投资基金注册的批复》核准，由新沃基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃创新领航混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 439,731,639.49 元，业经上会会计师事务所（特殊普通合伙）上会师报字（2020）第 9321 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新沃创新领航混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 12 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 439,778,077.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 46,437.95 份基金份额。本基金的基金管理人为新沃基金管理有限公司（以下简称“新沃基金”），基金托管人为宁波银行股份有限公司（以下简称“宁波银行”）。

根据《新沃创新领航混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、

C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、政府支持机构债、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例为 60%-95%；投资于本基金界定的创新领航主题的股票不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

本基金的财务报表于 2024 年 3 月 26 日已经本基金的基金管理人批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### ① 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 1) 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### ② 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

## (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发

生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最

近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值；

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理人报酬、托管费、销售服务费等按《基金合同》约定的方法进行计提。

(2) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

(3) 其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对其持有的 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的收益分配方式；选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按权益登记日对应类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作, 本基金确定以下股票投资、债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所



独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017

年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	1,624,814.55	4,193,550.34
等于：本金	1,624,630.84	4,193,113.20
加：应计利息	183.71	437.14
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	1,740,922.67	949,222.97
等于：本金	1,740,801.10	948,984.28
加：应计利息	121.57	238.69

减：坏账准备	-	-
合计：	3,365,737.22	5,142,773.31

注：其他存款本期期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	65,644,738.35	-	55,498,489.68	-10,146,248.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	65,644,738.35	-	55,498,489.68	-10,146,248.67
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	79,113,034.71	-	69,831,104.38	-9,281,930.33
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	79,113,034.71	-	69,831,104.38	-9,281,930.33

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

无。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

无。

#### 7.4.7.8 其他资产

无。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.17	3.42
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	112,000.00	112,000.00
合计	112,000.17	112,003.42

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

新沃创新领航混合 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,940,080.25	29,940,080.25
本期申购	4,787,223.65	4,787,223.65
本期赎回（以“-”号填列）	-8,862,022.50	-8,862,022.50

- 基金拆分/份额折算前		
基金拆分/份额折算变动份额		
本期申购		
本期赎回（以“-”号填列）		
本期末	25,865,281.40	25,865,281.40

金额单位：人民币元

新沃创新领航混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	65,129,723.91	65,129,723.91
本期申购	26,039,106.26	26,039,106.26
本期赎回（以“-”号填列）	-26,655,558.17	-26,655,558.17
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	64,513,272.00	64,513,272.00

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

新沃创新领航混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,107,017.30	-9,378,595.16	-6,271,577.86
加：会计政策变更 （若有）	-	-	-
前期差错更正 （若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	3,107,017.30	-9,378,595.16	-6,271,577.86
本期利润	-3,250,824.81	-56,018.30	-3,306,843.11
本期基金份额交易 产生的变动数	-242,190.52	936,574.49	694,383.97
其中：基金申购款	172,168.93	-1,331,819.21	-1,159,650.28
基金赎回款	-414,359.45	2,268,393.70	1,854,034.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-385,998.03	-8,498,038.97	-8,884,037.00

单位：人民币元

新沃创新领航混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,107,260.52	-20,269,185.78	-14,161,925.26
加：会计政策变更 (若有)	-	-	-
前期差错更正 (若有)	-	-	-
其他(若有)	-	-	-
本期期初	6,107,260.52	-20,269,185.78	-14,161,925.26
本期利润	-7,866,623.75	-808,300.04	-8,674,923.79
本期基金份额交易 产生的变动数	4,033.98	37,871.75	41,905.73
其中：基金申购款	559,780.48	-7,184,827.80	-6,625,047.32
基金赎回款	-555,746.50	7,222,699.55	6,666,953.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,755,329.25	-21,039,614.07	-22,794,943.32

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
活期存款利息收入	7,061.71	12,974.62
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	6,263.17	18,232.77
结算备付金利息收入	-	-
其他	15.32	375.60
合计	13,340.20	31,582.99

注：(1) “其他存款利息收入”为存放在证券经纪商的证券交易资金账户中的证券交易结算资金产生的利息收入；

(2) “其他”为期货保证金利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	113,694,102.35	109,451,321.67
减：卖出股票成本总额	123,482,094.29	117,707,744.04
减：交易费用	286,336.00	302,899.23
买卖股票差价收入	-10,074,327.94	-8,559,321.60

#### 7.4.7.15 债券投资收益

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	321,468.11	318,409.64
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	321,468.11	318,409.64

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-864,318.34	-21,922,161.00
——股票投资	-864,318.34	-21,922,161.00
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-

——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-864,318.34	-21,922,161.00

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
基金赎回费收入	40,629.92	58,765.12
合计	40,629.92	58,765.12

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
审计费用	32,000.00	32,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
开户费	-	-
交易费用	-	-
合计	112,000.00	112,000.00

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无。



### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
新沃基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
宁波银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
新沃联合资产管理有限公司	基金管理人的股东
新沃控股集团有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	963,812.98	1,240,824.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	397,484.21	510,110.21
应支付基金管理人的净管理费	566,328.77	730,714.23

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。2023 年 8 月 28 日起，本基金的管理费由 1.50%年费率降至 1.20%年费率。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	102,490.79	124,082.45

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新沃创新领航混合 A	新沃创新领航混合 C	合计
宁波银行股份有限公司	-	-	-
新沃基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新沃创新领航混合 A	新沃创新领航混合 C	合计
宁波银行股份有限公司	-	80.62	80.62
新沃基金管理有限公司	-	1,564.43	1,564.43
合计	-	1,645.05	1,645.05

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给新沃基金管理有限公司，再由新沃基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率

的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行股份有限公司	1,624,814.55	7,061.71	4,193,550.34	12,974.62

注：本基金的活期存款由基金托管人宁波银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行宁波银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所场内进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约

风险可能性很小；在银行间同业市场及证券交易所场外交易平台进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2022 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,365,737.22	-	-	-	3,365,737.22
结算备付金	1,016.84	-	-	-	1,016.84
交易性金融资产	-	-	-	55,498,489.68	55,498,489.68
应收申购款	-	-	-	51,642.36	51,642.36
资产总计	3,366,754.06	-	-	55,550,132.04	58,916,886.10

负债					
应付赎回款				17,098.77	17,098.77
应付管理人报酬				62,062.41	62,062.41
应付托管费				7,757.78	7,757.78
应付销售服务费				18,393.89	18,393.89
其他负债				112,000.17	112,000.17
负债总计				217,313.02	217,313.02
利率敏感度缺口	3,366,754.06			55,332,819.02	58,699,573.08
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,142,773.31				5,142,773.31
结算备付金	1,001.52				1,001.52
交易性金融资产				69,831,104.38	69,831,104.38
应收申购款				150,453.86	150,453.86
资产总计	5,143,774.83			69,981,558.24	75,125,333.07
负债					
应付赎回款				246,591.54	246,591.54
应付管理人报酬				98,209.92	98,209.92
应付托管费				9,820.97	9,820.97
应付销售服务费				22,406.18	22,406.18
其他负债				112,003.42	112,003.42
负债总计				489,032.03	489,032.03
利率敏感度缺口	5,143,774.83			69,492,526.21	74,636,301.04

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金在投资中主要通过通过对国内外宏观经济运行状况、财政和货币政策、产业政策环境以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间各类资产相对收益率的基础上，动态优化调整国内依法发行上市的股票、债券、现金等大类资产的配置。本基金非现金基金资产的 80%需投资于创新领航主题的股票。本基金所指的“创新领航”主题涵盖了把创新发展作为应对环境变化、增强发展动力、把握主动权的发展之策，实现关键核心技术自主可控、推动产品和产业向价值链中高端跃升、甚至引领行业发展新方向的优质上市企业。其他主要投资策略还包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略、存托凭证投资策略和融资业务投资策略。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；投资于本基金界定的创新领航主题的股票不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	55,498,489.68	94.55	69,831,104.38	93.56
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	55,498,489.68	94.55	69,831,104.38	93.56

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月	上年度末（2022 年 12 月



		31 日 )	31 日 )
	沪深 300 指数上升 5%	3,363,066.75	3,042,796.34
	沪深 300 指数下降 5%	-3,363,066.75	-3,042,796.34

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	55,498,489.68	69,831,104.38
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	55,498,489.68	69,831,104.38

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	-	-	-
当期购买	-	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	306,606.50	-	-	306,606.50
当期购买	-	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	290,215.11	-	-	290,215.11
当期利得或损失总额	-16,391.39	-	-	-16,391.39
其中：计入损益的利得或损失	-16,391.39	-	-	-16,391.39
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损	-	-	-	-

失的变动——公 允价值变动损益				
--------------------	--	--	--	--

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	55,498,489.68	94.20
	其中：股票	55,498,489.68	94.20
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	3,366,754.06	5.71
8	其他各项资产	51,642.36	0.09
9	合计	58,916,886.10	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,990,296.00	68.13
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,508,193.68	26.42
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	-	-
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	55,498,489.68	94.55

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688326	经纬恒润	36,000	4,177,800.00	7.12
2	000977	浪潮信息	107,000	3,552,400.00	6.05
3	688167	炬光科技	31,000	3,534,000.00	6.02
4	300115	长盈精密	227,800	3,018,350.00	5.14
5	688256	寒武纪	21,865	2,950,900.40	5.03
6	688041	海光信息	40,000	2,839,200.00	4.84
7	002517	恺英网络	233,200	2,604,844.00	4.44
8	002602	世纪华通	500,000	2,580,000.00	4.40
9	300620	光库科技	56,000	2,536,800.00	4.32
10	002624	完美世界	210,717	2,494,889.28	4.25
11	300502	新易盛	50,000	2,466,000.00	4.20
12	688048	长光华芯	39,000	2,444,130.00	4.16
13	300031	宝通科技	130,000	2,410,200.00	4.11
14	688200	华峰测控	18,000	2,210,400.00	3.77
15	300474	景嘉微	28,700	2,029,377.00	3.46
16	603019	中科曙光	50,000	1,974,500.00	3.36
17	002463	沪电股份	86,600	1,915,592.00	3.26
18	603650	彤程新材	53,000	1,764,900.00	3.01
19	300054	鼎龙股份	70,000	1,694,000.00	2.89
20	002929	润建股份	30,000	1,251,900.00	2.13
21	600460	士兰微	51,700	1,180,311.00	2.01
22	300017	网宿科技	118,000	926,300.00	1.58
23	603160	汇顶科技	12,700	877,570.00	1.50
24	603501	韦尔股份	8,000	853,680.00	1.45

25	605358	立昂微	30,000	821,700.00	1.40
26	300454	深信服	4,000	289,160.00	0.49
27	300666	江丰电子	1,700	99,586.00	0.17

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000977	浪潮信息	8,278,844.65	11.09
2	002602	世纪华通	5,646,082.00	7.56
3	600839	四川长虹	4,472,438.31	5.99
4	002624	完美世界	3,963,120.13	5.31
5	688256	寒武纪	3,619,665.01	4.85
6	002517	恺英网络	3,571,527.39	4.79
7	601390	中国中铁	3,538,976.00	4.74
8	601186	中国铁建	3,495,412.00	4.68
9	300031	宝通科技	3,456,069.00	4.63
10	002268	电科网安	3,303,585.00	4.43
11	002555	三七互娱	3,159,424.00	4.23
12	300659	中孚信息	3,096,796.00	4.15
13	688041	海光信息	3,061,681.61	4.10
14	600718	东软集团	2,895,526.00	3.88
15	002049	紫光国微	2,496,333.00	3.34
16	603019	中科曙光	2,453,823.00	3.29
17	300474	景嘉微	2,411,904.00	3.23
18	600339	中油工程	2,410,580.00	3.23
19	300847	中船汉光	2,401,838.00	3.22
20	002065	东华软件	2,349,709.00	3.15
21	600521	华海药业	2,335,726.00	3.13
22	002558	巨人网络	2,325,625.00	3.12
23	603258	电魂网络	2,261,210.00	3.03
24	300223	北京君正	2,058,743.09	2.76
25	688326	经纬恒润	2,017,870.57	2.70
26	002463	沪电股份	1,983,794.00	2.66
27	300502	新易盛	1,931,900.00	2.59

28	603650	彤程新材	1,930,317.00	2.59
29	000938	紫光股份	1,677,214.00	2.25
30	600602	云赛智联	1,635,564.00	2.19
31	603501	韦尔股份	1,619,920.37	2.17
32	002460	赣锋锂业	1,556,641.00	2.09
33	002466	天齐锂业	1,544,955.00	2.07

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	7,450,590.38	9.98
2	002460	赣锋锂业	6,940,874.20	9.30
3	000977	浪潮信息	5,211,397.94	6.98
4	600839	四川长虹	5,128,294.00	6.87
5	601186	中国铁建	4,099,382.00	5.49
6	601390	中国中铁	3,759,036.00	5.04
7	600703	三安光电	3,455,963.67	4.63
8	002558	巨人网络	3,080,376.00	4.13
9	600699	均胜电子	2,938,531.62	3.94
10	002268	电科网安	2,870,529.00	3.85
11	300896	爱美客	2,736,758.00	3.67
12	600718	东软集团	2,699,428.00	3.62
13	002602	世纪华通	2,698,628.00	3.62
14	300620	光库科技	2,627,734.84	3.52
15	300659	中孚信息	2,573,433.00	3.45
16	002036	联创电子	2,570,067.00	3.44
17	688363	华熙生物	2,498,170.65	3.35
18	600339	中油工程	2,427,256.00	3.25
19	002906	华阳集团	2,233,416.18	2.99
20	002065	东华软件	2,220,376.00	2.97
21	002555	三七互娱	2,169,276.00	2.91
22	600521	华海药业	2,155,903.00	2.89
23	603290	斯达半导	2,149,757.05	2.88
24	603197	保隆科技	2,081,615.00	2.79
25	300101	振芯科技	2,039,275.72	2.73
26	601689	拓普集团	2,018,177.00	2.70

27	603348	文灿股份	1,986,063.00	2.66
28	002049	紫光国微	1,977,579.00	2.65
29	300223	北京君正	1,924,329.00	2.58
30	000938	紫光股份	1,878,358.00	2.52
31	300957	贝泰妮	1,871,965.00	2.51
32	300847	中船汉光	1,782,394.00	2.39
33	688677	海泰新光	1,724,188.22	2.31
34	000887	中鼎股份	1,612,241.00	2.16
35	600602	云赛智联	1,580,308.00	2.12

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	110,013,797.93
卖出股票收入（成交）总额	113,694,102.35

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 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。

### 8.6 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。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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

浙江世纪华通集团股份有限公司（股票代码：002602.SZ），因在回购公司股票的过程中违反  
第 56 页 共 64 页



了相关规定,深圳证券交易所于 2023 年 2 月 17 日对其出具了监管函;因涉嫌信息披露违法违规,中国证监会于 2023 年 7 月对其立案调查。

西安炬光科技股份有限公司(股票代码:688167.SH)因未在规定时间内及时披露重大事件的进展变化,中国证监会陕西监管局于 2023 年 3 月 8 日对其出具警示函,上海证券交易所于 2023 年 3 月 23 日对其予以监管警示。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对上述证券进行了投资。

本报告期内基金投资的前十名证券的其余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。

### 8.12.2 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中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	51,642.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,642.36

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
新沃创新领航混合 A	6,784	3,812.69	301.71	0.00%	25,864,979.69	100.00%
新沃创新领航混合 C	26,646	2,421.12	281.65	0.00%	64,512,990.35	100.00%
合计	33,430	2,703.52	583.36	0.00%	90,377,970.04	100.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	新沃创新领航混合 A	9,988.21	0.0386%
	新沃创新领航混合 C	35,445.53	0.0549%
	合计	45,433.74	0.0503%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	新沃创新领航混合 A	0
	新沃创新领航混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新沃创新领航混合 A	0
	新沃创新领航混合 C	0~10
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新沃创新领航混合 A	新沃创新领航混合 C
基金合同生效日（2020年12月24日）基金份额总额	76,204,427.75	363,573,649.69
本报告期期初基金份额总额	29,940,080.25	65,129,723.91
本报告期基金总申购份额	4,787,223.65	26,039,106.26
减:本报告期基金总赎回份额	8,862,022.50	26,655,558.17
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	25,865,281.40	64,513,272.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，李钧先生新任本公司总经理、财务负责人职务，具体信息请参见基金管理人于 2023 年 11 月 18 日披露的《新沃基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；邢凯先生不再担任本公司总经理、财务负责人职务。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给上会会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 32,000.00 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	223,707,900.28	100.00%	163,607.46	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新沃创新领航混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 1 月 20 日
2	新沃基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 2 月 9 日
3	新沃创新领航混合型证券投资基金 2022 年年度报告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 3 月 30 日
4	新沃创新领航混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2023 年第 1 号)	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 4 月 20 日
5	新沃创新领航混合型证券投资基金(新沃创新领航混合 A 份额)基金产品资料概要(更新)	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 4 月 20 日
6	新沃创新领航混合型证券投资基金(新沃创新领航混合 C 份额)基金产品资料概要(更新)	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 4 月 20 日
7	新沃创新领航混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 4 月 21 日
8	新沃基金管理有限公司关于暂停官方网站、直销网上交易业务的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 4 月 25 日
9	新沃基金管理有限公司关于恢复官方网站、直销网上交易业务的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 5 月 6 日
10	新沃基金管理有限公司关于旗下部分基金新增麦高证券为基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 7 月 7 日
11	新沃基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 7 月 7 日
12	新沃创新领航混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 7 月 20 日
13	新沃基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 8 月 26 日

14	新沃创新领航混合型证券投资基金基金合同更新	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 8 月 26 日
15	新沃创新领航混合型证券投资基金托管协议更新	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 8 月 26 日
16	新沃创新领航混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2023 年第 2 号)	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 8 月 29 日
17	新沃创新领航混合型证券投资基金(新沃创新领航混合 A 份额)基金产品资料概要(更新)	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 8 月 29 日
18	新沃创新领航混合型证券投资基金(新沃创新领航混合 C 份额)基金产品资料概要(更新)	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 8 月 29 日
19	新沃创新领航混合型证券投资基金 2023 年中期报告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 8 月 30 日
20	新沃基金管理有限公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理旗下基金销售业务并为投资者办理转托管等相关业务的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 9 月 13 日
21	新沃基金管理有限公司关于高级管理人员变更及代为履行职务的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 10 月 17 日
22	新沃创新领航混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 10 月 24 日
23	新沃基金管理有限公司关于北京分公司负责人变更的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 11 月 17 日
24	新沃基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 11 月 18 日
25	新沃基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的风险提示公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 11 月 22 日
26	新沃基金管理有限公司关于提示投资者持续完善客户身份信息的公告	指定报刊和/或管理人网站	2023 年 12 月 25 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予新沃创新领航混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《新沃创新领航混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新沃创新领航混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《关于申请募集注册新沃创新领航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

### 13.2 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。

### 13.3 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

2024年3月28日