

新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

§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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华鑫益灵活配置混合
基金主代码	000584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 16 日
报告期末基金份额总额	124,660,771.55 份
投资目标	综合运用多种投资策略，在严格控制基金资产净值下行风险的基础上，力争为投资人提供长期稳定的绝对回报。
投资策略	投资策略的选择，本基金将兼顾下行风险控制 and 收益获取。在资产配置策略方面，主要采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，通过动态调整资产配置比例以控制基金资产整体风险。在股票投资策略方面，把握趋势跟随及绝对收益两个核心，趋势跟随策略以期在某行业或个股出现趋势性机会时，积极跟随其市场表现；绝对收益策略以类套利策略为目标，以期获取稳定的绝对回报。在债券投

	资策略方面，本基金将综合运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、杠杆策略及可转换债券投资策略，在获取稳定收益的同时，降低基金资产净值整体的波动性。	
业绩比较基准	年化收益率 10%	
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	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新华鑫益灵活配置混合 A	新华鑫益灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	014150	000584
报告期末下属分级基金的份额总额	79,245,229.83 份	45,415,541.72 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 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)	
	新华鑫益灵活配置混合 A	新华鑫益灵活配置混合 C
1.本期已实现收益	-9,391,074.93	-36,458,778.53
2.本期利润	4,819,916.01	17,671,628.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0611	0.3858
4.期末基金资产净值	52,664,249.53	204,868,378.14
5.期末基金份额净值	0.6646	4.5110

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

1、新华鑫益灵活配置混合 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
过去三个月	9.78%	2.12%	2.51%	0.00%	7.27%	2.12%
过去六个月	6.18%	1.73%	5.00%	0.00%	1.18%	1.73%
过去一年	-0.63%	1.50%	10.01%	0.00%	-10.64%	1.50%
自基金合同 生效起至今	-33.54%	1.42%	28.94%	0.00%	-62.48%	1.42%

2、新华鑫益灵活配置混合 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
过去三个月	9.63%	2.12%	2.51%	0.00%	7.12%	2.12%
过去六个月	5.92%	1.73%	5.00%	0.00%	0.92%	1.73%
过去一年	-1.13%	1.50%	10.01%	0.00%	-11.14%	1.50%
过去三年	-25.49%	1.43%	30.01%	0.00%	-55.50%	1.43%
过去五年	91.63%	1.50%	50.01%	0.00%	41.62%	1.50%
自基金合同 生效起至今	351.10%	1.37%	104.61%	0.00%	246.49%	1.37%

注：本基金自2021年11月9日起增加A类基金份额（基金代码：014150），原份额类别调整为C类份额（基金代码：000584）。

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

新华鑫益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
(2014年4月16日至2024年9月30日)

1. 新华鑫益灵活配置混合 A：



2. 新华鑫益灵活配置混合 C:



注：本基金自 2021 年 11 月 9 日起增加 A 类基金份额（基金代码:014150）。

§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		
蒋茜	本基金基金经理，副总经理兼权益投资总监、研究部总监，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、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理。	2024-07-03	-	12	工商管理硕士，曾任盖安德咨询公司高级分析师、中信证券股份有限公司高级经理、天安财产保险股份有限公司研究总监、渤海人寿保险股份有限公司权益投资总监、东方基金管理股份有限公司总经理助理。
赖庆鑫	本基金基金经理，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、新华优选成长混合型证	2023-11-23	-	12	车辆工程硕士，曾任泰达宏利基金管理有限公司研究部研究员、权益投资部基金经理。

	券投资基金基金 基金经 理、新华泛资 源优势 灵活配 置混合 型证券 投资基 金基金 基金经 理。				
--	---	--	--	--	--

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《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》、《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益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》、《新华鑫益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

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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%情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，市场先下后上，在 9 月中下旬逐步见底，最后呈现 V 型反转走势，整体市场表现相对较好。本季度沪深 300 指数上涨 16.1%，创业板指数上涨 29.2%，科创 50 指数上涨 22.5%。从申万一级行业涨跌幅去看，报告期内所有行业均有不同程度上涨。市场在金融、地产板块的带动下反弹显著，其中非银金融、房地产、商贸零售、社会服务、计算机等行业涨幅靠前；前期表现较好的抗跌红利类资产涨幅相对靠后，其中煤炭、石油石化、公用事业等行业涨幅靠后。报告期内，市场出现显著反转，资产价格得到有力修复。

报告期内，本基金的仓位调整幅度不大，从结构上整体降低了红利和周期资产的配置，增加了成长方向的配置，重点增配的方向有电子、汽车、计算机和国防军工，整体组合以科技和制造方向为主线，重点布局竞争格局稳定、具备技术壁垒、且在细分行业具备显著竞争优势的龙头公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 9 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 0.6646 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 9.78%，同期比较基准的增长率为 2.51%。本基金 C 类份额净值为 4.5110 元，本报告期 C 类份额净值增长率为 9.63%，同期比较基准的增长率为 2.51%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期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	233,766,113.77	89.28
	其中：股票	233,766,113.77	89.28
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	27,620,053.19	10.55
7	其他各项资产	457,782.62	0.17
8	合计	261,843,949.58	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	5,100,968.00	1.98
C	制造业	144,430,483.13	56.08
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	4,591,554.00	1.78
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	64,474,520.96	25.04
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	15,168,587.68	5.89
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	233,766,113.77	90.77

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通过港股通投资的股票。

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	002920	德赛西威	122,400	14,662,296.00	5.69
2	688111	金山办公	50,252	13,387,132.80	5.20
3	688692	达梦数据	40,053	12,554,790.95	4.88
4	688072	拓荆科技	82,766	11,918,304.00	4.63
5	688037	芯源微	141,659	11,736,448.15	4.56
6	688361	中科飞测	182,341	11,370,784.76	4.42
7	002594	比亚迪	36,600	11,247,546.00	4.37
8	300347	泰格医药	133,900	9,237,761.00	3.59
9	000768	中航西飞	327,400	9,036,240.00	3.51
10	688120	华海清科	54,340	8,796,015.80	3.42

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	144,838.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	312,944.38
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	457,782.62

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688692	达梦数据	26,703.95	0.01	新股锁定期内

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,分项和与合计之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华鑫益灵活配置混合 A	新华鑫益灵活配置混合 C
本报告期期初基金份额总额	85,869,883.47	46,642,659.02
报告期期间基金总申购份额	3,769,841.13	1,513,805.19
减：报告期期间基金总赎回份额	10,394,494.77	2,740,922.49
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	79,245,229.83	45,415,541.72

§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投资本基金。

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投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 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) 中国证监会准予新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《关于申请募集新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书》
- (三) 《新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (五) 《新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(更新)
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

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到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新华基金管理股份有限公司

二〇二四年十月二十五日