新华战略新兴产业灵活配置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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	新华战略新兴产业灵活配置混合
基金主代码	001294
交易代码	001294
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 日
报告期末基金份额总额	113,905,854.55 份
投资目标	重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会，综合运用多种投资策略，精选战略性新兴产业及其相关产业中的优质企业进行投资，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。大类资产

	配置策略主要运用战略性资产配置策略和战术性资产配置策略。股票投资策略指通过对战略性新兴产业发展状况的持续跟踪，以研究员以及基金经理的实地调研、密切跟踪以及扎实的案头分析工作为基础，采用自上而下与自下而上相结合的选股策略，动态精选能够充分受益于战略性新兴产业为主题的优质股票进行投资。具体运作方法包括对战略性新兴产业界定、战略性新兴产业主题挖掘、战略性新兴产业个股挖掘等方法。债券投资策略主要运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、中小企业私募债券选择策略、收益率曲线骑乘策略以及可转换债券投资策略等。
业绩比较基准	70%*中证新兴产业指数+30%*中证综合债券指数
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 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	7,368,356.21
2.本期利润	46,592,076.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.3008
4.期末基金资产净值	170,779,854.97
5.期末基金份额净值	1.4993

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	26.37%	1.33%	10.80%	0.86%	15.57%	0.47%
过去六个月	16.31%	1.73%	6.21%	1.12%	10.10%	0.61%
过去一年	73.33%	1.59%	25.20%	1.12%	48.13%	0.47%
过去三年	136.86%	1.52%	52.94%	1.12%	83.92%	0.40%
过去五年	64.94%	1.40%	51.63%	0.98%	13.31%	0.42%
自基金合同生效起至今	49.93%	1.51%	22.22%	1.22%	27.71%	0.29%

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

新华战略新兴产业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

(2015 年 6 月 29 日至 2021 年 6 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		
付伟	本基金基金经理，新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投	2020-09-28	-	10	西安交通大学工学硕士，北京大学工商管理硕士,历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理，新华基金管理股份有限公司行业研究员、制造业与 TMT 组组长，先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。

	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。				
申峰旗	本基金基金经理，新华基金副总经理兼投资总监，新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华趋势领航混合型证券投资基金基金经理、新华鑫泰灵活配置混合型证券	2020-10-14	2021-06-23	15	普林斯顿大学金融学硕士，历任长城人寿投资总监、长城财富保险资产管理公司副总经理，中信保诚人寿资产管理中心副总监、投资主管，嘉实基金投资经理；曾就职纽约的投资银行（巴克莱资本、花旗集团）和对冲基金（卡尔森资本）。

	投资基金基金经理。				

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遵规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华战略新兴产业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》、《新华战略新兴产业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 年二季度市场见底回升，周期、科技、消费均有所表现。本基金根据基金合同约定，重点配置了战略新兴产业方向的优质公司，收益率 26.37%，明显跑赢市场。后续将根据行业比较和个股比较，筛选出盈利趋势更好、预期差显著、估值有提升空间的行业和个股进行配置，争取获得稳定持续的超额收益。

国内疫情基本得到控制，经济逐渐步入正轨，从中长期看，科技创新、先进制造和消费升级是推动中国经济健康发展的重要推力，我们将重点配置相关行业的优质公司，包括人工智能、半导体、物联网、光伏、电动汽车、医药等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.4993 元，本报告期份额净值增长率为 26.37%，同期比较基准的增长率为 10.80%。

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	161,982,749.57	93.13
	其中：股票	161,982,749.57	93.13
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	11,194,056.06	6.44
7	其他各项资产	757,152.85	0.44
8	合计	173,933,958.48	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	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	132,954,757.90	77.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	46,404.58	0.03
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	10,205,371.64	5.98
J	金融业	5,186,030.10	3.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,250,750.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	6,576,780.00	3.85
N	水利、环境和公共设施管理业	31,153.31	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	1,917,240.00	1.12
R	文化、体育和娱乐业	2,764,580.00	1.62
S	综合	-	-
	合计	161,982,749.57	94.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末，本基金未持有港股通股票。

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	300750	宁德时代	13,300	7,112,840.00	4.16
2	603259	药明康德	42,000	6,576,780.00	3.85
3	603799	华友钴业	59,523	6,460,626.42	3.78
4	603501	韦尔股份	18,500	5,957,000.00	3.49
5	002415	海康威视	82,000	5,289,000.00	3.10
6	300059	东方财富	157,100	5,151,309.00	3.02
7	300496	中科创达	31,500	4,947,390.00	2.90
8	601012	隆基股份	55,200	4,903,968.00	2.87
9	002594	比亚迪	19,300	4,844,300.00	2.84
10	002756	永兴材料	81,500	4,840,285.00	2.83

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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属。

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

报告期末，本基金未持有权证。

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

本基金合同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（1）“华友钴业”公告显示，公司于 2020 年 12 月 30 日收到中国证券监督管理委员会浙江监管局下发的《关于对浙江华友钴业股份有限公司采取责令改正措施的决定》([2020]110 号)，公司存在违反《上市公司信息披露管理办法》行为，中国证监会浙江证监局决定对华友钴业采取责令改正的监督管理措施。

“华友钴业”的发行人浙江华友钴业股份有限公司于 2020 年 9 月 18 日，因其未对载运货

物性质尽到注意义务，在货物载运进口时，未正确办理进口手续，而收到嘉兴海事局处罚2.0736 万元的罚款。

（2）“药明康德”的发行人于 2021 年 6 月 15 日收到上交所对其下达的监管工作函，要求上海瀛翊及药明康德高度重视此次违反承诺减持股份事件，并要求其进行全面自查、整改，及时进行信息披露。

（3）“韦尔股份”发行人上海韦尔半导体股份有限公司，因资产质押情况未及时在临时公告中披露，上海监管局对其采取出具警示函的监管措施。(《关于上海韦尔半导体股份有限公司采取出具警示函措施的决定》，沪证监决〔2021〕67 号，2021 年 4 月 28 日)。

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，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	157,199.33
2	应收证券清算款	290,796.85
3	应收股利	-
4	应收利息	1,655.66
5	应收申购款	307,501.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	757,152.85

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	603799	华友钴业	6,460,626.42	3.78	非公开发行

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	171,953,951.37
报告期期间基金总申购份额	7,016,526.48
减：报告期期间基金总赎回份额	65,064,623.30
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	113,905,854.55

§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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210401 - 20210531	35,366,047.75	0.00	35,366,047.75	0.00	0.00%

产品特有风险
1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险； 2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动； 3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算； 4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。 1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险； 2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动； 3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算； 4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

8.2 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）中国证监会批准新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

（二）关于申请募集新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

（三）《新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（四）《新华战略新兴产业灵活配置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《新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

（七）《新华战略新兴产业灵活配置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