

**新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)**  
**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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	新华精选成长主题 3 个月持有期混合(FOF)
基金主代码	009146
交易代码	009146
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 26 日
报告期末基金份额总额	28,315,665.50 份
投资目标	本基金将精选具有成长风格的金牛基金以及其他优质基金构建投资组合，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略包括资产配置策略、基金投资策略、债权投资策略。 本基金运用定量与定性相结合的研究方法进行基金精选，对国内公开募集的开放式证券投资基金的业绩、风险、持仓、规模、

	<p>持有人结构和费率等要素进行定量分析,对拟投资的基金投资策略、决策流程、风险措施、基金经理、投资团队、研究支持和公司管理等要素进行定量及定性分析,自下而上精选出投资能力稳健、持续业绩良好、投资风格稳定的基金。</p> <p>基金管理人将同时入选金牛成长核心基金池和重点投资基金池的优质基金组成“精选成长组合”。本基金以“精选成长组合”为投资重点,辅以全市场精选出的优质基金构建投资组合,在保持适度流动性、控制风险的前提下增厚组合收益。</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金,其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金,高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金。
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
	(2021年7月1日-2021年9月30日)
1.本期已实现收益	1,965,944.76
2.本期利润	-2,115,181.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0640
4.期末基金资产净值	35,617,253.32
5.期末基金份额净值	1.2579

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

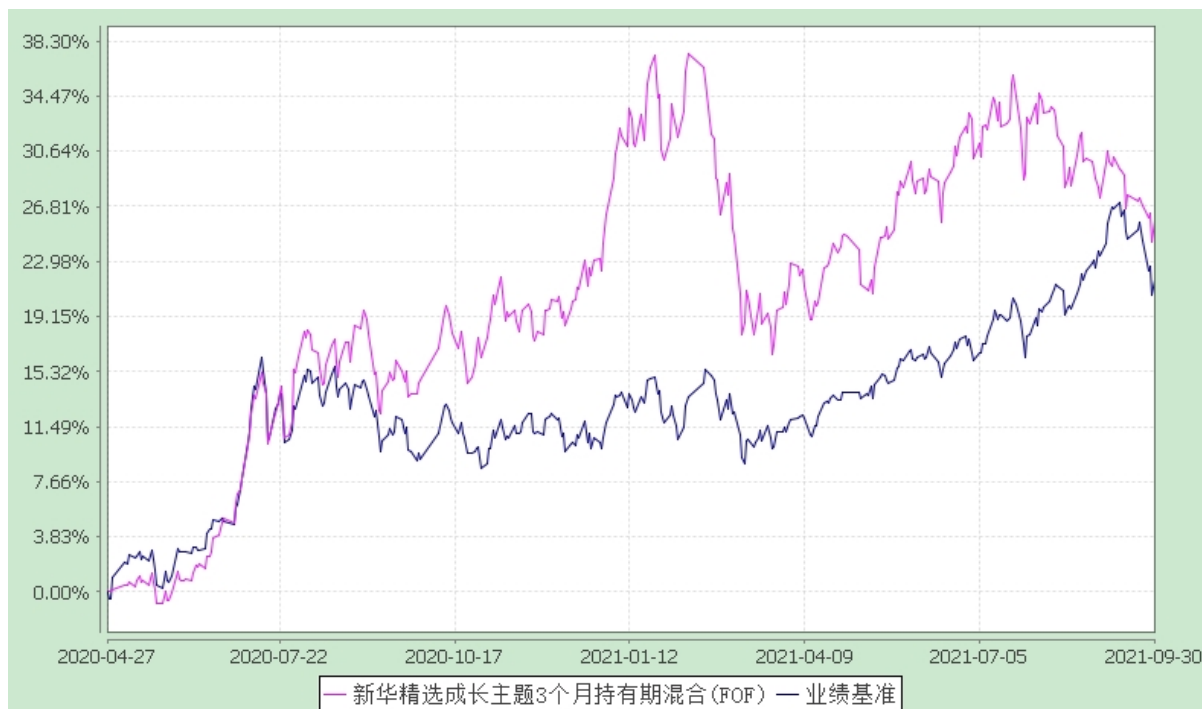
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.64%	1.07%	3.44%	0.68%	-9.08%	0.39%
过去六个月	4.81%	0.99%	9.45%	0.56%	-4.64%	0.43%
过去一年	9.70%	1.10%	11.33%	0.64%	-1.63%	0.46%
自基金合同生效起至今	25.79%	1.05%	21.66%	0.72%	4.13%	0.33%

注：本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

#### 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

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2020 年 4 月 26 日至 2021 年 9 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		
王奕蕾	本基金基金经理，新华基金管理有限公司基金投资部	2020-04-26	-	9	金融学硕士，历任方正证券股份有限公司研究所研究员，先后担任固定收益分析师和基金分析师，新华基金投资经理。

	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》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精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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

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年三季度以来，在国内疫情频现、房地产市场受到政策和恒大事件冲击加剧，以及多地出台能耗双控政策的影响下，2021年三季度经济下行幅度超出市场预期。同时，教育行业“双减”、互联网反垄断等产业政策出台引发外资短期集中流出，叠加美联储QE减量渐行渐近，市场风险偏好下行，三季度权益市场整体表现较弱。

从近期的金融及经济数据来看，社融增速持续回落，消费和投资数据下行压力加大，四季度经济增速不容乐观，双碳目标之下预计四季度PPI仍然维持高位，类滞胀的局面仍将延续。由于经济的下行压力较大，我们认为四季度货币政策仍会保持相对宽松，后续伴随着财政专项债在今年后置发行，以及跨周期调节政策的实施，社融增速或有望在四季度企稳。近期中美关系阶段性缓和，有利于增强外资对A股的投资热情，并推动中美贸易进一步正常化，对于前期受打压行业获得改善。短期市场的不确定性主要集中在某些房地产企业风险以及政策应对措施上，四季度A股可能仍处在区间震荡的局面中，依旧要优选风格和板块。权益市场方面，继续看好新能源这个高景气赛道，中长期空间大，短期业绩也有较好的支撑，但前期涨幅过大，目前估值较高，需严控仓位，挑选在该板块上个股挖掘能力较强的产品。同时，看好金融板块四季度的表现。消费医药等核心资产近期大幅回调，具备一定的左侧配置价值，但由于消费数据较弱，还未到大幅买入的时候。由于供给端受限，上游资源品三季度涨幅较大，虽然周期板块的季报仍高增，但涨幅过大，后续周期板块的性价比在逐步降低。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年09月30日，本基金份额净值为1.2579元，本报告期份额净值增长率为-5.64%，同期业绩比较基准的增长率为3.44%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金自2021年8月12日至2021年9月30日出现连续三十四个工作日，出现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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	25,373,155.35	70.55
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	3,465,945.81	9.64
8	其他各项资产	7,128,098.01	19.82
9	合计	35,967,199.17	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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转让股票。



#### **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**

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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 本基金未投资股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,620.36
2	应收证券清算款	7,122,062.31
3	应收股利	-
4	应收利息	659.88
5	应收申购款	755.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,128,098.01

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

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例	是否属于基 金管理人及 管理人关联 方所管理的 基金
1	001714	工银文体 产业股票	契约型开 放式	943,458.2 8	3,256,817.9 8	9.14%	否
2	519091	新华泛资 源优势混 合	契约型开 放式	406,484.3 1	2,933,637.9 1	8.24%	是
3	004231	中欧行业 成长混合 (LOF)C	契约型开 放式	1,177,366. 93	2,814,966.5 9	7.90%	否
4	202023	南方优选 成长混合 A	契约型开 放式	490,402.5 2	2,295,574.2 0	6.45%	否
5	121006	国投瑞银 稳健增长	契约型开 放式	753,241.5 9	2,044,297.6 8	5.74%	否
6	217010	招商大盘 蓝筹混合	契约型开 放式	633,604.2 5	1,992,685.3 7	5.59%	否
7	001878	嘉实沪港 深精选股 票	契约型开 放式	800,468.9 5	1,761,832.1 6	4.95%	否
8	100016	富国天源	契约型开	483,500.9	1,467,425.4	4.12%	否

		沪港深平 衡混合	放式	7	4		
9	270021	广发聚瑞 混合	契约型开 放式	291,535.1 8	1,457,238.6 0	4.09%	否
10	009275	融通医疗 保健行业 混合 C	契约型开 放式	467,435.3 4	1,375,662.2 1	3.86%	否

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理人 以及管理人关联方所管理基金 产生的费用
当期交易基金产生的申购费	-	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	43,194.67	-
当期持有基金产生的应支付销 售服务费(元)	9,024.34	-
当期持有基金产生的应支付管 理费(元)	130,994.09	12,439.28
当期持有基金产生的应支付托 管费(元)	22,050.84	1,127.29
当期持有基金产生的转换费 (元)	5,355.22	-
当期交易基金产生的交易费 (元)	606.53	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实

际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金持有的基金未发生重大影响事件。

## §7 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	39,243,053.30
本报告期期间基金总申购份额	2,655,718.76
减：本报告期期间基金总赎回份额	13,583,106.56
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	28,315,665.50

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内无基金管理人持有本基金份额的情况。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)募集的文件
- (二) 关于申请募集新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)之法律意见书
- (三) 《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)托管协议》
- (四) 《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)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) 《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》(更新)
- (七) 《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)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

### 10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 10.3 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。