

新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金
2023 年第 4 季度报告
2023 年 12 月 31 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年一月十九日

§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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 012200 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 5 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 166,767,206.30 份 |
| 投资目标 | 本基金通过合理的资产配置，精选科技主题的优质企业进行投资，在控制基金资产净值下行风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中证科技 100 指数收益率×60%+中债综合指数（总财富）收益率×30%+恒生指数收益率×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平低于股票 |

| | | |
|-----------------|--|------------------------|
| | 型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 新华基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 华夏银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A | 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012200 | 012201 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 123,501,643.17 份 | 43,265,563.13 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 (2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日) | |
|----------------|---|------------------------|
| | 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A | 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -8,016,632.98 | -2,866,556.99 |
| 2.本期利润 | -9,159,890.96 | -3,282,017.67 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0718 | -0.0723 |
| 4.期末基金资产净值 | 91,393,280.11 | 31,604,273.49 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.7400 | 0.7305 |

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

1、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 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 | -8.73% | 1.14% | -2.96% | 0.75% | -5.77% | 0.39% |
| 过去六个月 | -19.24% | 1.23% | -10.34% | 0.75% | -8.90% | 0.48% |
| 过去一年 | -4.49% | 1.50% | -1.66% | 0.75% | -2.83% | 0.75% |
| 自基金合同 生效起至今 | -26.00% | 1.62% | -15.07% | 0.87% | -10.93% | 0.75% |

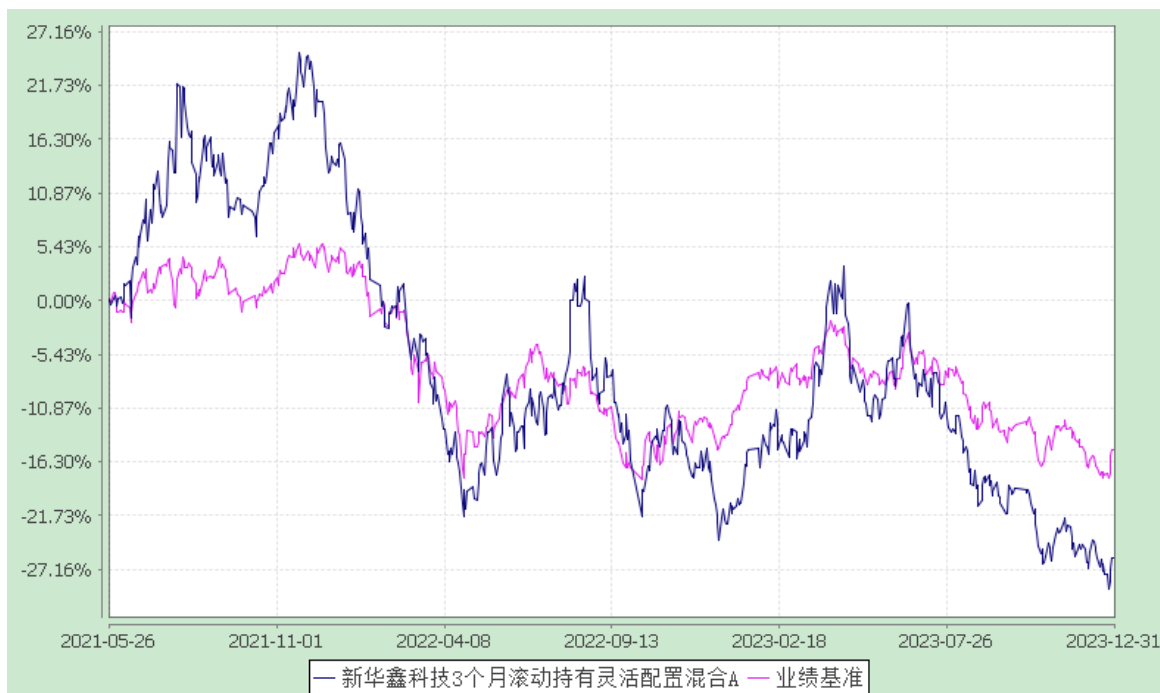
2、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C：

| 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 | -8.84% | 1.14% | -2.96% | 0.75% | -5.88% | 0.39% |
| 过去六个月 | -19.44% | 1.23% | -10.34% | 0.75% | -9.10% | 0.48% |
| 过去一年 | -4.96% | 1.50% | -1.66% | 0.75% | -3.30% | 0.75% |
| 自基金合同 生效起至今 | -26.95% | 1.62% | -15.07% | 0.87% | -11.88% | 0.75% |

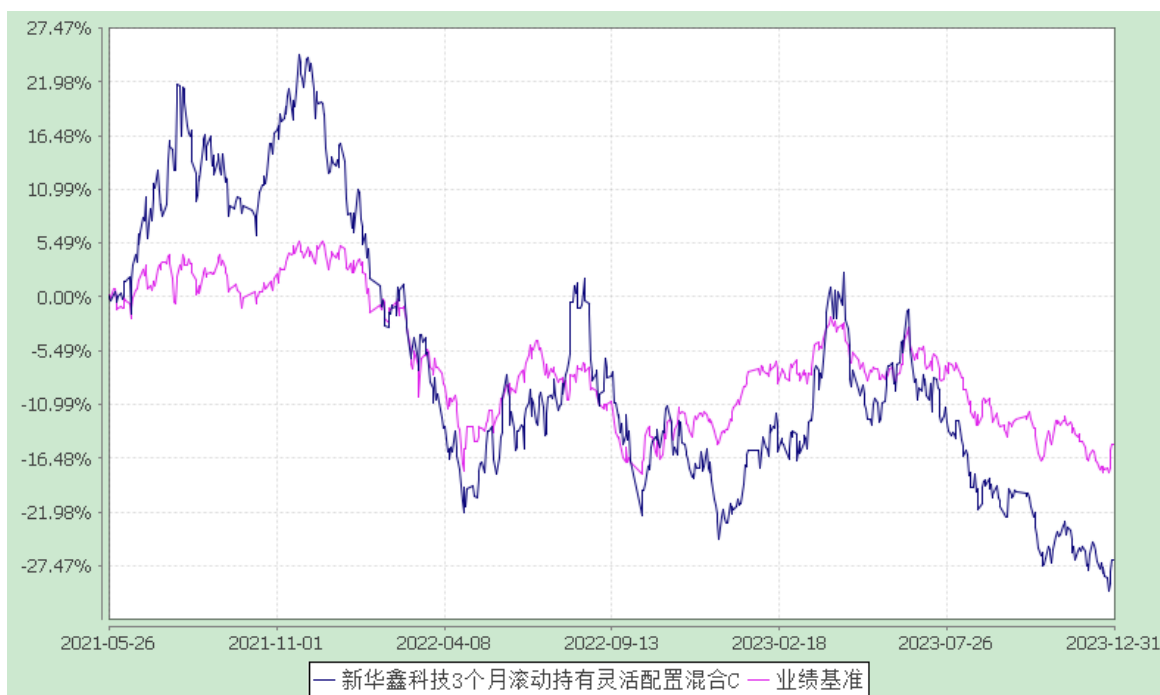
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华鑫科技 3 个月滚动持有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
(2021 年 5 月 26 日至 2023 年 12 月 31 日)

1. 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 A：



2. 新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合 C:



注：本报告期末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 | | |
| 王永明 | 本基金基金经理，新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华景气行业混合型证券投资基金基金经理。 | 2021-09-03 | - | 25 | 经济学博士，历任西南证券资产管理部研究员、恒泰证券研发中心经理、上海名禹资产管理有限公司研究总监、上海尚阳投资管理有限公司投资总监。 |

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科技 3 个月滚动持有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》、《新华鑫科技 3 个月滚动持有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》，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

2023 年在新发展理念下，改革开放和产业结构优化都取得了一定的成果，高质量发展继续扎实推进。与此同时，经济回升向好仍面临着一定的困难和压力，如国内有效需求不足、预期不稳、房地产供求关系出现实质性转变、外部环境严峻、复杂等。从证券市场看，主要指数出现先扬后抑的走势，在上半年冲高后，下半年却出现不同程度的调整。四季度的 A 股市场延续了下半年以来的调整态势，期间上证综指、创业板和科创 50 指数分别下跌 4.36%、5.62%、4.03%，申万 31 个一级行业中，仅煤炭、电子、农业、综合小幅上涨，其余 27 个行业均有不同程度的下跌。下跌的行业中，顺周期的商贸、美容护理、电力设备和地产产业链跌幅较大。本基金四季度对结构和仓位均进行了调整，增配了受益于科技创新的消费电子产业链，但受市场系统性因素的影响，基金净值仍出现一定的回撤。

2023 年 12 月，中央经济工作会议的召开，在 2024 年各项任务中，科技创新被摆在头一条，显示高层对科技创新的重视程度。除政策支持外，由人工智能等带来的创新驱动和行业库存周期变化带来的周期驱动仍在继续，我们继续看好科技成长板块的投资机会，看好以下领域的投资机会：1、创新驱动的 AI 产业链、MR 产业链、智能驾驶和卫星互联网产业链。2、周期反转的存储、模拟、射频、CIS 等。3、国产半导体设备和材料、算力芯片等。

经历了持续两年的调整后，证券市场的风险出现一定程度的出清，2024 年孕育着机会和希望，我们将在基本面扎实研究、紧密跟踪和深入理解的基础上，顺应经济、产业和市场的趋势，敬畏、观察和思考市场的持续变化和重大变化，重视市场呈现出的格局和结果，在高景气的行业中寻找高性价比的投资标的，为持有人创造超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 0.7400 元，本报告期份额净值增长率为 -8.73%，同期比较基准的增长率为 -2.96%；本基金 C 类份额净值为 0.7305 元，本报告期份额净值增长率为 -8.84%，同期比较基准的增长率为 -2.96%。

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元的情况。

§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 | 111,680,325.11 | 90.22 |
| | 其中：股票 | 111,680,325.11 | 90.22 |
| 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 | 12,104,080.67 | 9.78 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,600.12 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 123,788,005.90 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为人民币907,473.30元，占期末净值比例0.74%。

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 | 36,234.48 | 0.03 |
| C | 制造业 | 99,364,976.79 | 80.79 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 41,153.13 | 0.03 |
| E | 建筑业 | 2,085,992.52 | 1.70 |
| F | 批发和零售业 | 422,407.21 | 0.34 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,569.57 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | 7,351.56 | 0.01 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,550,139.84 | 6.14 |
| J | 金融业 | 29,204.89 | 0.02 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 83,368.72 | 0.07 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 533,903.65 | 0.43 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 291,211.14 | 0.24 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 184,550.60 | 0.15 |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 128,787.71 | 0.10 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 110,772,851.81 | 90.06 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|------------|--------------|
| 非日常生活消费品 | 70,508.45 | 0.06 |
| 工业 | 2,020.87 | 0.00 |
| 通信服务 | 834,943.98 | 0.68 |
| 合计 | 907,473.30 | 0.74 |

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 | 002475 | 立讯精密 | 246,200 | 8,481,590.00 | 6.90 |
| 2 | 002241 | 歌尔股份 | 343,200 | 7,210,632.00 | 5.86 |
| 3 | 300308 | 中际旭创 | 52,900 | 5,972,939.00 | 4.86 |
| 4 | 688012 | 中微公司 | 28,761 | 4,417,689.60 | 3.59 |
| 5 | 000063 | 中兴通讯 | 151,300 | 4,006,424.00 | 3.26 |
| 6 | 603501 | 韦尔股份 | 35,900 | 3,830,889.00 | 3.11 |
| 7 | 002463 | 沪电股份 | 171,083 | 3,784,355.96 | 3.08 |
| 8 | 600941 | 中国移动 | 37,400 | 3,720,552.00 | 3.02 |
| 9 | 688200 | 华峰测控 | 28,074 | 3,447,487.20 | 2.80 |
| 10 | 300502 | 新易盛 | 69,300 | 3,417,876.00 | 2.78 |

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

本基金本报告期末无贵金属投资。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金基金合同无国债期货投资策略。

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

本基金基金合同无国债期货投资策略。

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

本报告期末本基金投资的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之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,600.12 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,600.12 |

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

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

| 项目 | 新华鑫科技3个月滚动 持有灵活配置混合A | 新华鑫科技3个月滚动 持有灵活配置混合C |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 130,919,977.45 | 46,539,751.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 318,233.53 | 669,617.89 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 7,736,567.81 | 3,943,805.96 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 123,501,643.17 | 43,265,563.13 |

§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

本报告期内本基金无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鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三)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
- (四)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (五)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (六)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(更新)
- (七)《新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》(更新)
- (八)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (九)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (十)基金托管人业务资格批件及营业执照

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

二〇二四年一月十九日