

# 新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年第 3 季度报告

2017 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年十月二十六日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 新华科技创新主题灵活配置混合  |
| 基金主代码      | 002272  |
| 交易代码       | 002272  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2016 年 3 月 22 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 92,065,026.72 份   |
| 投资目标       | 重点关注国家战略发展过程中带来的投资机会，综合运用多种投资策略，精选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科技创新主题相关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科技创新主题相关产业的优质股票进行投资。具体运作方法包括对科技创新产业界定、科技创新产业主题挖掘、科技创新产业个股挖掘等方法。债券投资策略主要运用久期策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略、中小企业私募债券选择策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×30%   |
| 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                              |
|-----------------|----------------------------------|
|                 | (2017 年 7 月 1 日-2017 年 9 月 30 日) |
| 1. 本期已实现收益      | 15,436,727.91                    |
| 2. 本期利润         | 13,278,323.16                    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0844                           |
| 4. 期末基金资产净值     | 100,485,910.34                   |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.091                            |

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 | 8.88%  | 0.63%     | 4.01%      | 0.44%         | 4.87% | 0.19% |

#### 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

新华科技创新主题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  
 (2016年3月22日至2017年9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 |        |  |
| 李会忠 | 本基金基金经理, 新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫锐混合型证券投资基金基金经理。 | 2016-03-22  | -    | 10     | 经济学硕士, 10 年证券从业经验。2007 年 9 月加入新华基金管理股份有限公司, 历任新华基金管理股份有限公司行业研究员、策略分析师、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理助理。现任新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫锐混合型证券投资基金基金经理。 |

|     |   |            |   |   |   |
|-----|---|------------|---|---|---|
|     | 基金基金<br>经理、新华鑫锐<br>混合型<br>证券投资<br>基金基金<br>经理、新华鑫益<br>灵活配<br>置混合<br>型证券<br>投资基<br>金基金<br>经理、<br>新华行<br>业轮换<br>灵活配<br>置混合<br>型证券<br>投资基<br>金基金<br>经理。 |            |   |   |   |
| 张永超 | 本基金<br>基金经<br>理，新<br>华健康<br>生活主<br>题灵活<br>配置混<br>合型证<br>券投资<br>基金基<br>金经<br>理、新<br>华鑫锐<br>混合型<br>证券投<br>资基金<br>基金经<br>理、新<br>华鑫弘<br>灵活配             | 2017-01-20 | - | 7 | 工商管理硕士，7 年证券从业经验，历任中信证券股份有限公司量化投资经理、北京乐正资本管理有限公司高级投资经理、中融国际信托有限公司投资经理。2016 年 3 月加入新华基金管理股份有限公司，现任新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫锐混合型证券投资基金基金经理、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华华盛灵活 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  | <p>置混合型证券投资基金基金经理、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华华盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华华荣灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华恒益</p> |  |  |  | <p>配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华华荣灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

|  |   |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|
|  | 量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理。 |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|

#### 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科技创新主题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》、《新华科技创新主题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、金融工程部和监察稽核部，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业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，市场热点较多，各指数都呈现出上涨季线。其中周期股、金融股表现亮眼。我们通过提高仓位获取贝塔收益，并通过择优获取阿尔法收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.091 元，本报告期份额净值增长率为 8.88%，同期比较基准的增长率为 4.01%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场风险偏好有所提升，融资余额接近万亿，热点板块较多，且持续性加强。随着监管的有效引导，投资者结构变化，稳健向好的基本面成为驱动股价的主要因素。

### 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              | 95,262,484.49  | 93.54        |
|    | 其中：股票             | 95,262,484.49  | 93.54        |
| 2  | 固定收益投资            | 2,448,339.30   | 2.40         |
|    | 其中：债券             | 2,448,339.30   | 2.40         |
|    | 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      | 3,970,561.13   | 3.90         |
| 7  | 其他各项资产            | 165,302.88     | 0.16         |
| 8  | 合计                | 101,846,687.80 | 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         | 1,063,934.86  | 1.06         |
| B  | 采矿业              | 1,782,996.60  | 1.77         |
| C  | 制造业              | 44,726,277.78 | 44.51        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 291,287.36    | 0.29         |
| E  | 建筑业              | 3,756,667.52  | 3.74         |
| F  | 批发和零售业           | 3,009,016.08  | 2.99         |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 2,072,085.16  | 2.06  |
| H | 住宿和餐饮业          | 163,444.80    | 0.16  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,349,439.77  | 3.33  |
| J | 金融业             | 20,824,945.64 | 20.72 |
| K | 房地产业            | 4,121,878.73  | 4.10  |
| L | 租赁和商务服务业        | 3,642,095.00  | 3.62  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 1,675,556.00  | 1.67  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 2,632,689.51  | 2.62  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -             | -     |
| P | 教育              | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | 115,299.99    | 0.11  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 1,637,523.69  | 1.63  |
| S | 综合              | 397,346.00    | 0.40  |
|   | 合计              | 95,262,484.49 | 94.80 |

### 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  | 603728 | 鸣志电器 | 180,000   | 4,611,600.00 | 4.59         |
| 2  | 601398 | 工商银行 | 693,000   | 4,158,000.00 | 4.14         |
| 3  | 601988 | 中国银行 | 1,000,330 | 4,121,359.60 | 4.10         |
| 4  | 601688 | 华泰证券 | 168,800   | 3,818,256.00 | 3.80         |
| 5  | 000776 | 广发证券 | 187,468   | 3,558,142.64 | 3.54         |
| 6  | 601288 | 农业银行 | 888,898   | 3,395,590.36 | 3.38         |
| 7  | 000415 | 渤海金控 | 405,000   | 2,681,100.00 | 2.67         |
| 8  | 000666 | 经纬纺机 | 91,175    | 1,850,852.50 | 1.84         |
| 9  | 000716 | 黑芝麻  | 246,500   | 1,555,415.00 | 1.55         |
| 10 | 600161 | 天坛生物 | 45,827    | 1,506,333.49 | 1.50         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券 | 2,448,339.30 | 2.44         |
| 2  | 央行票据 | -            | -            |

|    |           |              |      |
|----|-----------|--------------|------|
| 3  | 金融债券      | -            | -    |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -    |
| 4  | 企业债券      | -            | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -    |
| 6  | 中期票据      | -            | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -    |
| 8  | 同业存单      | -            | -    |
| 9  | 其他        | -            | -    |
| 10 | 合计        | 2,448,339.30 | 2.44 |

#### 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量(张)  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019557 | 17 国债 03 | 24,530 | 2,448,339.30 | 2.44         |

注：报告期末，本基金有且仅持有一只债券。

#### 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

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金合同尚无国债期货投资政策。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2016 年 11 月 28 日华泰证券收到中国证监会《行政处罚决定书》，经查明。华泰证券存在以下违法事实：截止调查日华泰证券有 455 个使用杭州恒生网络技术服务有限公司 HOMS 系统，61 个使用浙江核新同花顺网络信息股份有限公司系统接入违规交易的主账户，对上述客户，华泰证券未按要求采集客户交易终端信息，未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性，未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息，证监会对华泰证券给予警告，没收违法所得 18,235,275.00 元并处以 54,705,825.00 元罚款。

2016 年 11 月 28 日广发证券收到中国证监会《行政处罚决定书》，经查明，广发证券存在以下违法事实：截至调查日，广发证券共有 123 个使用 HOMS 系统、FPRC 系统接入的主账户。其中使用 HOMS 系统接入的主账户 113 个（下挂虚拟账户或子账户 16,427 个），使用 FPRC 系统接入的主账户 10 个（下挂虚拟账户或子账户 2,883 个）。广发证券未采集客户交易终端信息，未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性，未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。证监会决定：对广发证券责令改正，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。

本报告期内，本基金投资的其他前十名证券的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。

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   | 115,111.92 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 44,844.20  |
| 5  | 应收申购款   | 5,346.76   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 165,302.88 |

### 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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

|              |                |
|--------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 212,593,491.32 |
|--------------|----------------|

|              |                |
|--------------|----------------|
| 报告期基金总申购份额   | 1,531,033.55   |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 122,059,498.15 |
| 报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期末基金份额总额  | 92,065,026.72  |

## § 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

本基金管理人本报告期末未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期末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

| 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              | 20170701-20170821      | 79,285,431.12 | 0.00 | 79,285,431.12 | 0.00          | 0.00%  |
|       | 2              | 20170822-20170930      | 26,999,000.00 | 0.00 | 0.00          | 26,999,000.00 | 29.33% |

#### 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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金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科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (四) 新华科技创新主题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《新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (九) 中国证监会要求的其他文件

### 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

二〇一七年十月二十六日