

新华趋势领航混合型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十五日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华趋势领航混合
基金主代码	519158
交易代码	519158
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 11 日
报告期末基金份额总额	289,192,832.89 份
投资目标	把握整体市场和行业中的趋势机会，精选具有盈利增长趋势以及股票价格趋势的优质上市公司进行投资，在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续、稳定增长。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的主动投资策略，深入分析并积极跟踪驱动股票市场、债券市场、行业板块、公司股价形成上升趋势的根本性因素，通过前瞻性地把握市场中存在的趋势机会，完成本基金的大类资产配置、行

	业配置、债券类属品种配置以及投资组合的最终构建。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率 +20%×上证国债指数收益率。
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	中国工商银行股份有限公司

§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
	(2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	6,283,089.22
2.本期利润	-128,240,077.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3968
4.期末基金资产净值	811,542,374.04
5.期末基金份额净值	2.8062

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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	-12.95%	1.90%	-12.08%	0.71%	-0.87%	1.19%
过去六个月	-3.77%	1.98%	-7.44%	0.95%	3.67%	1.03%
过去一年	-20.35%	1.92%	-16.94%	0.94%	-3.41%	0.98%
过去三年	69.07%	1.72%	3.19%	1.01%	65.88%	0.71%
过去五年	80.02%	1.56%	5.25%	1.02%	74.77%	0.54%
自基金合同生效起至今	334.56%	1.54%	57.12%	1.14%	277.44%	0.40%

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

新华趋势领航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
(2013 年 9 月 11 日至 2022 年 9 月 30 日)



注：报告期内本基金的各项资产配置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	说明
----	----	-------------	-------	----

		任职日期	离任日期	限	
栾超	本基金基金经理，联席权益投资总监、权益投资部副总监，新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华景气行业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投资基金	2020-05-26	-	10	经济学硕士，历任中邮创业基金管理股份有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。

	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》、《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趋势领航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》、《新华趋势领航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》，以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

2022 年三季度，A 股市场分化加剧，热点切换较快。本基金坚持自上而下选择景气度高的行业，包括储能、海风、军工等成长性较好的子行业。同时自下而上在上述行业中精选个股，以科技制造业为主线进行配置。投资中从我国经济发展阶段出发，把握产业转型升级和全球化的发展趋势，重点投资了高端制造业中具备全球比较优势的行业和公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 2.8062 元，本报告期份额净值增长率为 -12.95%，同期比较基准的增长率为 -12.08%。

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	726,017,705.30	87.12
	其中：股票	726,017,705.30	87.12
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	106,805,679.12	12.82
7	其他各项资产	537,448.74	0.06
8	合计	833,360,833.16	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	-	-
C	制造业	710,579,976.67	87.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,120.04	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,951.13	0.00
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	9,414,636.80	1.16
J	金融业	17,249.67	0.00
K	房地产业	4,209,663.00	0.52
L	租赁和商务服务业	13,621.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,059,457.96	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	197,206.85	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	366,440.24	0.05
R	文化、体育和娱乐业	93,381.94	0.01
S	综合	-	-
	合计	726,017,705.30	89.46

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

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	603606	东方电缆	885,300	61,731,969.00	7.61
2	600522	中天科技	2,582,199	58,022,011.53	7.15
3	300274	阳光电源	523,930	57,957,136.60	7.14
4	300750	宁德时代	143,367	57,474,396.63	7.08
5	002594	比亚迪	165,320	41,662,293.20	5.13
6	600487	亨通光电	2,271,520	41,341,664.00	5.09
7	000301	东方盛虹	2,123,200	36,986,144.00	4.56
8	002812	恩捷股份	178,007	30,994,578.84	3.82
9	002049	紫光国微	204,860	29,499,840.00	3.64
10	688390	固德威	102,722	29,073,407.66	3.58

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

本报告期末本基金无股指期货投资。

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

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

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

1、“比亚迪”发行人比亚迪股份有限公司于 2022 年 6 月 7 日，被江苏省消费者权益保护委员会就“新能源汽车行业不公平格式条款”的最新情况及后续整改落实问题进行约谈。

2、“中天科技”的发行人江苏中天科技股份有限公司：

(1)2022 年 1 月 11 日收到上交所监管警示函（上证公监函（2021）0168 号），上市公司的业务订单量和预测性数据属于投资者高度关注的重要经营性信息，对上市公司股票交易价格和投资者决策可能产生较大影响。上述相关信息应当根据规则由公司在符合中国证监会规定的指定媒体上真实、准确、完整地披露。

(2) 2022 年 6 月 30 日收到上交所监管警示函（上证公监函（2022）0078 号）：经查明，2022 年 4 月 30 日，江苏中天科技股份有限公司（以下简称中天科技或公司）披露会计差错更正公告称，公司于 2019 年新增高端通信业务，主要产品为多网融合通信基站用设备，鉴于高端通信业务经营过程中，公司未能就原材料采购和产品销售拥有足够的定价权，高端通信业务收入确认由“总额法”变更为“净额法”，并采用追溯重述法对 2019 年度、2020 年度的财务数据进行追溯调整、对 2021 年 1 至 9 月数据进行更正。

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 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,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	467,408.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	70,039.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	537,448.74

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

本报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

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

本报告期初基金份额总额	336,327,297.88
报告期期间基金总申购份额	4,492,534.06
减：报告期期间基金总赎回份额	51,626,999.05
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	289,192,832.89

§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	20220701-20220930	92,953,475.39	0.00	33,441,460.72	59,512,014.67	20.58%

产品特有风险

本基金力争前瞻性地把握市场、行业以及个股中的趋势机会顺势而为，以获取超额收益。虽然本基金管理人将通过严格的投资决策流程和个股筛选标准进行大类资产配置、行业配置以及投资组合构建，但仍存在因趋势判断过早或错判所导致的投资风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

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) 中国证监会批准新华趋势领航混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华趋势领航混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 《新华趋势领航混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《新华趋势领航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《新华趋势领航混合型证券投资基金招募说明书》
- (七) 《新华趋势领航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

二〇二二年十月二十五日