

# 新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金

## 2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年四月二十日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 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 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	新沃通盈灵活配置混合
交易代码	002564
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日
报告期末基金份额总额	6,180,557.48 份
投资目标	本基金以风险管理为前提，通过把握中国稳增长与促转型的发展现状，灵活运用多种投资策略，挖掘各大类资产配置机会，力求高于业绩比较基准的长期资产增值。
投资策略	本基金在深度把握中国经济发展与转型的基础上，通过自上而下的宏观-中观-微观的资产配置策略，以及自下而上的精选行业、个股的基本面分析策略，再通过定性分析和定量分析相结合的选股方法，辅以多种事件驱动、量化研究等工具策略，在风险管理的前提下因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产长期增值。
业绩比较基准	65%×沪深 300 指数收益率+35%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	新沃基金管理有限公司
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（2024年1月1日—2024年3月31日）
1. 本期已实现收益	-711,412.00
2. 本期利润	-54,971.57
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0089
4. 期末基金资产净值	7,231,756.11
5. 期末基金份额净值	1.170

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

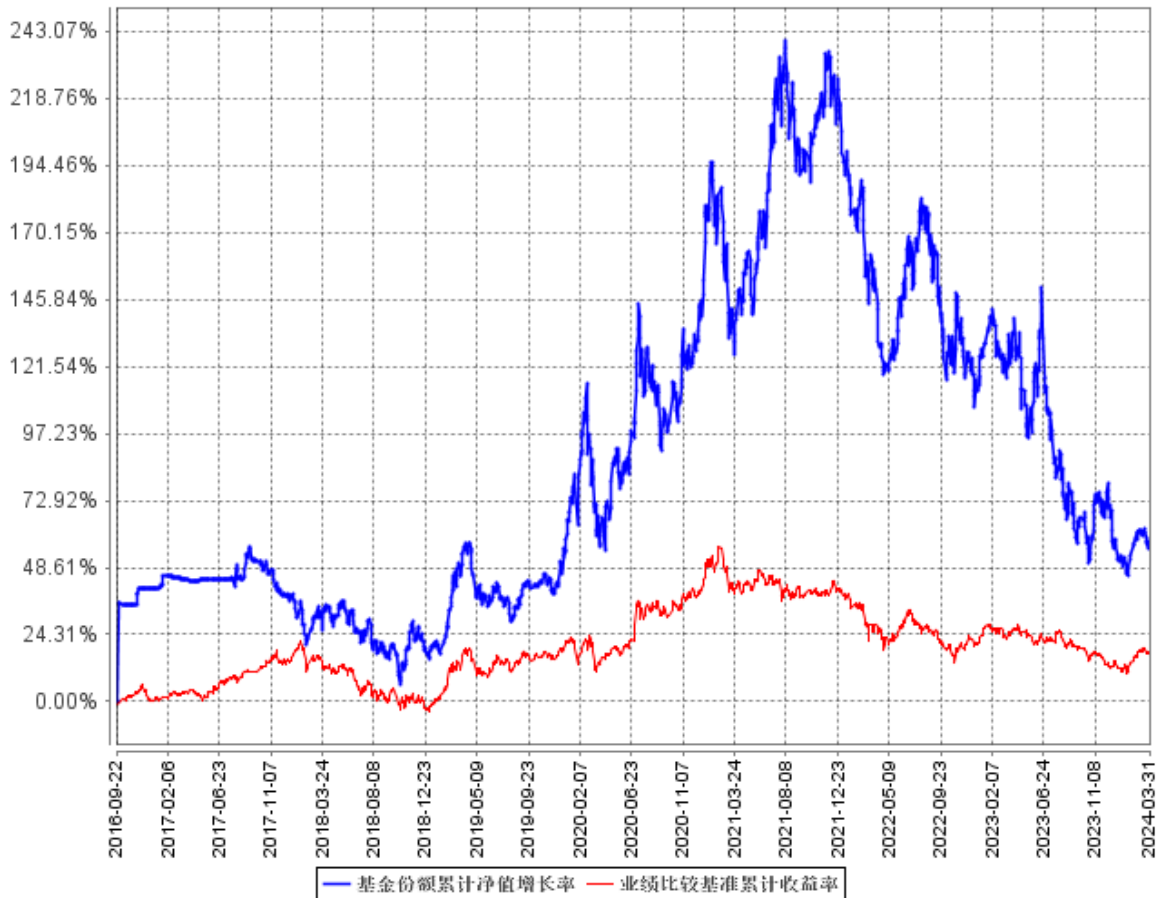
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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	-0.68%	0.95%	2.79%	0.60%	-3.47%	0.35%
过去六个月	-5.42%	1.39%	-1.07%	0.54%	-4.35%	0.85%
过去一年	-29.86%	1.87%	-5.79%	0.54%	-24.07%	1.33%
过去三年	-34.34%	1.77%	-16.48%	0.69%	-17.86%	1.08%
过去五年	5.60%	1.84%	2.63%	0.79%	2.97%	1.05%
自基金合同 生效起至今	57.87%	1.80%	18.00%	0.76%	39.87%	1.04%

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日为 2016 年 9 月 22 日，本基金的建仓期为 6 个月，在建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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		
刘腾飞	本基金的基金经理	2023 年 12 月 20 日	-	5 年	重庆大学金融学硕士，中国籍。2016 年 7 月起在新沃控股集团有限公司投资管理部担任投资经理。2018 年 9 月加入新

					沃基金管理有限公司，历任投资研究部研究员、投资经理，现担任基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------------

- 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、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

#### 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

本报告期内，基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为公平对待投资者，保护投资者利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做出明确具体的规定。本报告期内，本基金管理人严格执行相关规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

从经济运行情况来看，2024 年一季度 GDP 同比增长 5.3%，全国规模以上工业增加值同比增长 6.1%，社会消费品零售总额同比增长 4.7%，全国固定资产投资同比增长 4.5%，货物进出口总额同比增长 5.0%，其中出口增长 4.9%；进口增长 5.0%。3 月制造业采购经理指数较前值上升 1.7 个百分点至 50.8%，较过去五年季节性水平平均值的差距缩小到 0.4 个百分点，较 1-2 月情况明显改善。总体上，报告期内我国经济基本面延续修复态势，供给端修复显著快于需求端。

从市场运行情况来看，一季度主要指数先抑后扬，年初至春节前，经济数据不及预期，尤其是小盘遭遇流动性危机大幅下挫，中证 1000 一度下跌了接近 30%，带动市场出现较大调整，创 2020 年以来新低。春节后，流动性宽松以及各项稳市场政策出台，市场逐步修复，主要指数均有所反弹。风格方面，在政策作用下，一季度大盘蓝筹涨幅居前，沪深 300 上涨 3.10%，而中小盘则调整较多，尤其是小微盘。

报告期内，本基金在深入分析宏观经济和产业发展趋势的基础上，通过主观研究叠加量化分析的研究方法，制定了控制风险和抓取超额收益相均衡的投资策略，捕捉在当前市场环境下被显著低估的因子，挖掘基本面稳健、具备长期发展潜力的优秀上市公司。当前红利风格仍具备优势，但从中期视角来看，如果经济复苏的方向延续，则市场风格可能在未来某个时期发生切换。因此，在二季度，本基金将逐步增加成长标的的持仓，适度增加对创业板的风险暴露，同时继续严格控制组合整体风险，在收益与风控之间追求更优的均衡。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.170 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.68%，业绩比较基准收益率为 2.79%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况；本基金于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会报告并提出解决方案，本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

## § 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	5,922,343.49	79.58
	其中：股票	5,922,343.49	79.58
2	基金投资	-	-
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	1,516,858.48	20.38
8	其他资产	3,190.03	0.04
9	合计	7,442,392.00	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	170,674.00	2.36
C	制造业	3,332,127.49	46.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	491,465.00	6.80
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	151,590.00	2.10
J	金融业	1,602,282.00	22.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	174,205.00	2.41
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,922,343.49	81.89

## 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通投资股票。

## 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	002810	山东赫达	29,500	409,460.00	5.66
2	601500	通用股份	73,400	385,350.00	5.33
3	601058	赛轮轮胎	16,700	245,156.00	3.39
4	000425	徐工机械	35,300	224,508.00	3.10
5	601985	中国核电	24,200	222,398.00	3.08
6	601633	长城汽车	9,400	214,696.00	2.97
7	600999	招商证券	15,100	210,796.00	2.91
8	600030	中信证券	10,200	195,840.00	2.71
9	002466	天齐锂业	4,000	191,880.00	2.65
10	600160	巨化股份	7,200	170,352.00	2.36

## 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

山东赫达集团股份有限公司（股票代码：002810.SZ）：因其公司高管邱某亲属涉嫌短线交易，深圳证券交易所于 2023 年 8 月 4 日对邱某出具监管函，中国证监会于 2023 年 10 月对邱某立案，并于 2024 年 1 月 3 日对邱某给予警告并处以罚款。

招商证券股份有限公司（股票代码：600999.SH），因公司对从业人员的管理存在问题，深圳证监局于 2024 年 1 月 1 日对其采取责令增加内部合规检查次数措施的行政监管措施；因公司在“15 城六局”债券的受托管理方面，存在未督导发行人做好募集资金管理、未持续跟踪和监督发行人履行有关信息披露义务等情形，中国证监会安徽证监局于 2024 年 1 月 12 日对其采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案；因公司未对发行人充分、审慎核查，深圳证券交易所于 2023 年 9 月 1 日对其采取书面警示的自律监管措施；因公司发布证券研究报告业务存在问题，深圳证监局于 2023 年 6 月 4 日对其采取出具警示函的行政监管措施。

中信证券股份有限公司（股票代码：600030.SH），因公司在相关主体违反限制性规定转让非公开发行股票过程中涉嫌违法违规，中国证监会于 2024 年 3 月 13 日对其立案；因公司保荐的可转债项目，中国证监会于 2024 年 1 月 12 日对其采取出具警示函的行政监管措施；因公司在担任收购项目财务顾问时存在违规情形，中国证监会于 2023 年 9 月 22 日对其采取监管谈话的行政监管措施；因公司存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题，深圳证券交易所于 2023 年 9 月 22 日对其采取书面警示的自律监管措施，上海证券交易所于 2023 年 8 月 29 日对其采取书面警示的监管措施，深圳证监局于 2023 年 7 月 7 日对其采取出具警示函的行政监管措施；因公司未对发行人充分核查，上海证券交易所于 2023 年 5 月 17 日对其予以监管警示；因公司担任保荐人的过程中存在违规行为，深圳证券交易所于 2023 年 4 月 12 日对其采取书面警示的自律监管措施；因公司作为保荐机构在持续督导的过程中未充分核查，西藏证监局对其采取出具警示函的行政监督管理措施。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程

序对上述证券进行了投资。

本报告期内基金投资的前十名证券的其余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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未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	2,922.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	267.60
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,190.03

### 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

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	6,381,183.99
报告期期间基金总申购份额	188,195.38
减：报告期期间基金总赎回份额	388,821.89
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	6,180,557.48

## § 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,878,908.13
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,878,908.13
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	30.40

### 7.2 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，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

## § 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	2024/01/01-2024/03/31	1,878,908.13	-	-	1,878,908.13	30.40%
个人	2	2024/01/01-2024/03/31	1,276,933.73	-	-	1,276,933.73	20.66%
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理</p>							

人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# § 9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《关于申请募集注册新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

## 9.2 存放地点

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

## 9.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

新沃基金管理有限公司

2024 年 4 月 20 日