

新华鑫回报混合型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 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：二〇二四年十月二十五日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华鑫回报混合
基金主代码	001682
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 2 日
报告期末基金份额总额	76,034,036.89 份
投资目标	综合运用多种投资策略，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，采取稳健的债券投资策略和股票投资策略。本基金的主要投资策略包括：大类资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券的投资策略、股票投资策略、权证的投资策略等。
业绩比较基准	45%×沪深 300 指数收益率+55%×中国债券总指数收益率
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
	(2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-1,847,346.19
2.本期利润	4,744,928.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0610
4.期末基金资产净值	90,608,073.72
5.期末基金份额净值	1.1917

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	5.59%	0.86%	7.42%	0.68%	-1.83%	0.18%
过去六个月	3.04%	0.97%	7.00%	0.54%	-3.96%	0.43%

过去一年	-6.72%	1.10%	6.32%	0.48%	-13.04%	0.62%
过去三年	-15.75%	0.82%	-4.50%	0.48%	-11.25%	0.34%
过去五年	12.64%	0.80%	9.02%	0.52%	3.62%	0.28%
自基金合同生效起至今	32.12%	0.93%	19.46%	0.54%	12.66%	0.39%

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

新华鑫回报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
 (2015 年 9 月 2 日至 2024 年 9 月 30 日)



§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		
王丹	本基金基金经理, 新	2021-12-30	-	14	金融学硕士, 曾任民生证券高级分析师, 平安养老保险股份有限公司研究经理、研

	华双利债券型证券投资基金基金经理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。				究总监、高级投资经理。
--	---	--	--	--	-------------

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《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》、《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回报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》、《新华鑫回报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

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下

管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，经济基本面仍然呈现疲软，债券市场先涨后跌，前期上涨主要是源于经济偏弱，美国降息预期和国内货币政策宽松，后期下跌主要是因为 9 月末一系列提振资本市场和经济的政策，债券收益率整个季度来看仍然呈现陡峭下行，短端下行幅度更大，3 年期国债收益率下行高达 24BP，10 年期和 30 年期国债收益率分别下行 6BP 和 7BP 至 2.15% 和 2.36%，权益市场表现跟债券市场相反，前期持续调整，8 月份可转债市场出现比较大的下跌，9 月末系列提振经济和资本市场政策出台后，权益市场大幅反弹，整个季度来看，上证综合指数和沪深 300 指数分别上涨 12.4% 和 17.7%。

今年以来权益市场波动非常大，因此本基金股票和转债仓位调整非常灵活，以适应市场，我们后续将加强对市场和政策的认知，争取为投资者提供更好收益，我们未来看好的方向仍然是科技，可转债市场也是本基金重点投资的领域。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.1917 元，本报告期份额净值增长率为 5.59%，同期比较基准的增长率为 7.42%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期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	26,496,570.41	28.75
	其中：股票	26,496,570.41	28.75

2	固定收益投资	51,169,690.28	55.51
	其中：债券	51,169,690.28	55.51
	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	11,003,224.65	11.94
	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	3,011,289.50	3.27
7	其他各项资产	493,372.26	0.54
8	合计	92,174,147.10	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	2,590,080.00	2.86
C	制造业	23,244,360.41	25.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	662,130.00	0.73
J	金融业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	26,496,570.41	29.24

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通过港股通投资的股票。

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	002371	北方华创	8,500	3,110,830.00	3.43
2	688012	中微公司	16,313	2,675,332.00	2.95
3	600489	中金黄金	170,400	2,590,080.00	2.86
4	002156	通富微电	85,200	1,950,228.00	2.15
5	600690	海尔智家	56,100	1,803,615.00	1.99
6	688361	中科飞测	23,165	1,444,569.40	1.59
7	000333	美的集团	18,600	1,414,716.00	1.56
8	688008	澜起科技	18,603	1,244,168.64	1.37
9	000921	海信家电	32,200	1,143,100.00	1.26
10	688409	富创精密	24,291	1,122,244.20	1.24

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	19,668,108.46	21.71
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）	31,501,581.82	34.77
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,169,690.28	56.47

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	019740	24 国债 09	90,000	9,070,436.71	10.01
2	110059	浦发转债	50,000	5,540,531.51	6.11
3	019739	24 国债 08	41,000	4,171,306.30	4.60
4	240015	24 付息国 债 15	40,000	4,010,134.79	4.43
5	019742	24 特国 01	23,000	2,416,230.66	2.67

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	53,432.18
2	应收证券清算款	400,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	39,940.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	493,372.26

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	5,540,531.51	6.11
2	123176	精测转 2	1,917,518.18	2.12
3	123115	捷捷转债	1,541,389.27	1.70
4	118004	博瑞转债	1,434,225.92	1.58
5	118037	上声转债	1,404,312.71	1.55
6	113621	彤程转债	1,395,558.52	1.54
7	123131	奥飞转债	1,356,855.81	1.50
8	127073	天赐转债	1,040,840.27	1.15
9	123107	温氏转债	1,037,661.40	1.15
10	113061	拓普转债	968,949.09	1.07
11	110062	烽火转债	896,608.60	0.99
12	118025	奕瑞转债	847,728.36	0.94
13	110090	爱迪转债	684,473.33	0.76
14	113648	巨星转债	612,407.56	0.68
15	123101	拓斯转债	583,902.61	0.64
16	113658	密卫转债	538,176.66	0.59
17	113678	中贝转债	507,503.11	0.56
18	128137	洁美转债	499,569.67	0.55
19	113060	浙 22 转债	497,389.56	0.55
20	123114	三角转债	489,928.89	0.54
21	110089	兴发转债	439,242.12	0.48
22	118024	冠宇转债	435,743.44	0.48
23	113675	新 23 转债	360,163.11	0.40
24	127100	神码转债	331,976.92	0.37
25	127069	小熊转债	323,701.37	0.36
26	127076	中宠转 2	317,539.64	0.35
27	127066	科利转债	303,864.83	0.34
28	113661	福 22 转债	293,853.47	0.32
29	123169	正海转债	290,254.11	0.32
30	123145	药石转债	267,628.79	0.30
31	111007	永和转债	266,836.03	0.29
32	123161	强联转债	263,997.36	0.29
33	127064	杭氧转债	263,994.58	0.29
34	113616	韦尔转债	250,971.13	0.28
35	127074	麦米转 2	250,571.05	0.28
36	123071	天能转债	242,900.80	0.27
37	113059	福莱转债	238,295.78	0.26
38	123170	南电转债	141,442.76	0.16
39	127067	恒逸转 2	133,036.31	0.15
40	113677	华懋转债	126,394.94	0.14

41	113638	台 21 转债	123,920.42	0.14
42	128122	兴森转债	120,784.85	0.13

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

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	78,258,793.40
报告期期间基金总申购份额	138,306.18
减：报告期期间基金总赎回份额	2,363,062.69
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	76,034,036.89

§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投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人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

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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)中国证监会准予新华鑫回报混合型证券投资基金注册的文件
- (二)《关于申请募集新华鑫回报混合型证券投资基金之法律意见书》
- (三)《新华鑫回报混合型证券投资基金基金合同》
- (四)《新华鑫回报混合型证券投资基金托管协议》
- (五)《新华鑫回报混合型证券投资基金招募说明书》(更新)
- (六)基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七)基金托管人业务资格批件、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到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新华基金管理股份有限公司

二〇二四年十月二十五日