

新华优选分红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：二〇二四年四月十九日

§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。

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

§2 基金产品概况

| | | |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------|------------|
| 基金简称 | 新华优选分红混合 | |
| 基金主代码 | 519087 | |
| 交易代码 | 519087（前端） | 519088（后端） |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2005 年 9 月 16 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,423,885,247.68 份 | |
| 投资目标 | 有效地控制风险，实现基金净值增长持续地超越业绩比较基准并提供稳定的分红。 | |
| 投资策略 | 采用战术型资产配置策略；寻找品质优异的高成长型上市公司及分红能力强的价值型上市公司，并辅助以国际竞争力比较，寻找具有市场估值合理的股票，确定最终的投资组合。 | |
| 业绩比较基准 | 60%×沪深 300 指数+40%×上证国债指数 | |

| | |
|--------|-----------------------------------------------|
| 风险收益特征 | 本基金属于中等风险的混合型基金，其风险收益特征从长期平均来看，介于股票基金与债券基金之间。 |
| 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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日) |
| 1.本期已实现收益 | -109,529,517.12 |
| 2.本期利润 | -36,151,984.24 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0229 |
| 4.期末基金资产净值 | 756,542,293.09 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.5313 |

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

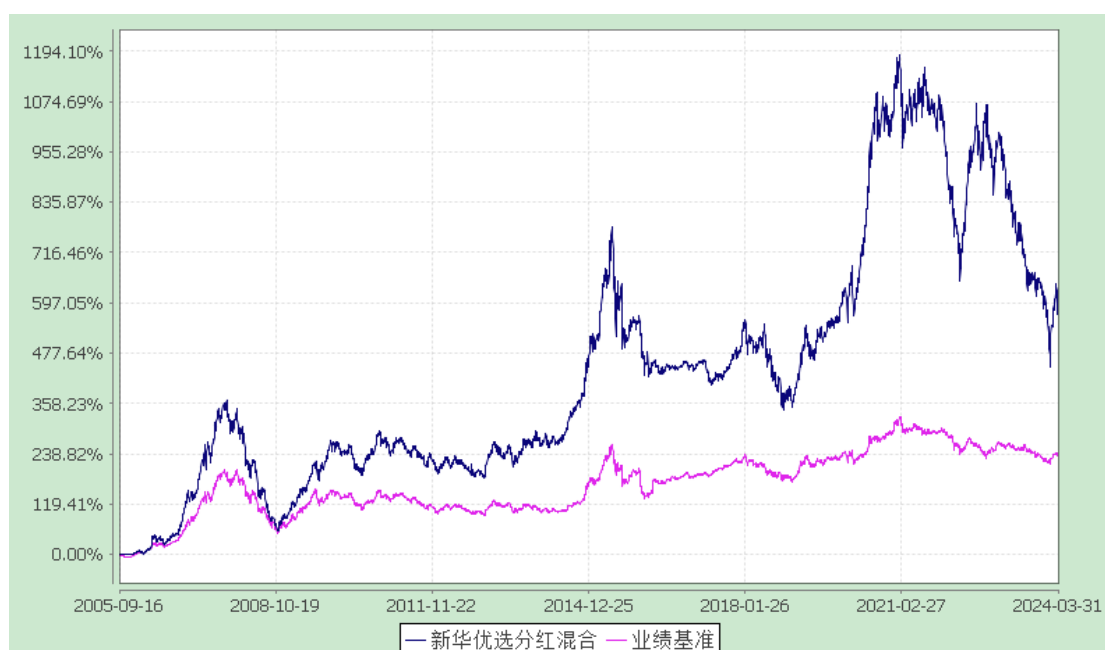
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | -4.65% | 2.33% | 2.72% | 0.61% | -7.37% | 1.72% |
| 过去六个月 | -11.11% | 1.82% | -1.30% | 0.55% | -9.81% | 1.27% |
| 过去一年 | -29.63% | 1.60% | -5.74% | 0.53% | -23.89% | 1.07% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三年 | -40.97% | 1.52% | -14.20% | 0.64% | -26.77% | 0.88% |
| 过去五年 | 11.04% | 1.48% | 4.75% | 0.71% | 6.29% | 0.77% |
| 自基金合同生效起至今 | 578.56% | 1.49% | 237.82% | 0.96% | 340.74% | 0.53% |

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

新华优选分红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
 (2005 年 9 月 16 日至 2024 年 3 月 31 日)



注：本报告期末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 | | |
| 赵强 | 本基金基金经理，权 | 2017-05-17 | - | 20 | 管理学硕士，历任国金基金高级研究员、英大基金基金经理、中欧基金投资经理。 |

| | | | | | |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|
| | <p>益投资 总监、 权益投 资部总 监、基 金投资 部总 监、研 究部总 监，新 华策略 精选股 票型证 券投资 基金基 金经 理、新 华行业 轮换灵 活配置 混合型 证券投 资基金 基金经 理、新 华行业 龙头主 题股票 型证券 投资基 金基金 经理、 新华趋 势领航 混合型 证券投 资基金 基金经 理、新 华安享 多裕定 期开放 灵活配 置混合</p> | | | | |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|------------------------------------|--|--|--|--|
| | 型证券投资基金基金经理、新华行业周期轮换混合型证券投资基金基金经理。 | | | | |
|--|------------------------------------|--|--|--|--|

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优选分红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》、《新华优选分红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

2024 年一季度，市场出现了较大波动，1 月份出现整体暴跌，2 月份大幅反弹，3 月份震荡波动加大，最终市场一季度末上证站在 3000 点以上。波动巨大的主要原因是流动性也出现了短暂问题，杠杆产品和衍生产品被迫平仓造成市场快速探底，微盘股也出现了系统性坍塌。随后的政策呵护止住了下跌趋势，市场也出现了强劲反弹。我们认为，2024 年市场风格也会更加均衡，机构重仓的板块，调整后的估值已经很低，2024 年会有较大的反弹空间。一是目前比较确定是 2024 年美债利率将会继续回落，虽然近期美国通胀水平回落较慢，大宗商品价格对通胀压力加大，但美联储还是维持今年三次降息的预期，美联储肯定了近期经济衰退压力缓解以及通胀整体下滑的良好趋势，市场担心的通胀压力将逐渐缓解，利率将回落，美元指数也会走软，人民币将开始反弹，这对外资重新流入开始有利，部分机构资金开始回流。二是 2024 年国家将继续保持较大力度的稳增长措施，近期增发的 1 万亿国债，对城中村改造力度加大，对房地产限制政策的调整和资金支持，这些都对经济复苏有所帮助，从 3 月份 PMI 数据好转已经看到经济复苏的迹象，特别是出口数据强劲。我们认为，伴随国内政策加码，经济逐步改善，国内企业盈利有望延续去年的趋势有所增长。我们预计随着 2024 年的 CPI 和 PPI 转正，企业盈利将进一步好转，届时市场将会信心修复，也会有比较大的恢复行情。目前经过调整后的优秀公司，投资价值将更加具备吸引力，目前这个时点，是非常好的长期配置时机。

2024 年一季度，低估值高分红等红利公司延续了去年稳定上涨的态势，创造了较高的超额收益，主要原因是当前国内资金宽松、10 年以上长期国债利率不断刷新新低的背景下，

大量长期资金缺少高收益的稳定资产配置，资产荒越发严重，因此高股息的红利公司成为避险和追求绝对收益资产配置的主要方向，成为大家一致看好的板块。不过对这类资产我们也要保持清醒的认识，股价的上涨会掩盖很多问题，投资者也有很多认知的误区，有几个关键点需要深入思考：

1、高分红的本质是上市公司没有好的投资项目，无法创造超过资金成本的高回报率，因此选择把盈利返还给投资者。如果公司本身还有高回报率的项目而不去投资，反而为了分红而去分红，则是毁损股东价值。

2、高分红可持续的资金来源只能是自由现金流，而不是经营现金流，自由现金流是剔除资本开支后真正可以用于股东回报的资金。对于重资产的行业，由于折旧巨大，先天就会是经营现金流好，但这些资金是无法用来分红的，必须要首先做资本开支。那些重资产、资本约束高、高财务杠杆的行业，靠借债或者减少资本开支来筹集资金，为了分红而去分红，则对股东长期价值并无益处，也会让企业背负更沉重的负担。

3、对于低估值的公司，高分红才能有高的股息率，对于高估值公司即使全部分红，股息率也不会很高。因此，当股价涨幅较高或者估值已经超过 20 倍，股息率自然就会降低，股息的吸引力也会大幅下降，股价上涨是股息率的敌人而不是朋友。只有高 ROE、有强劲自由现金流的公司才具备持续高分红的基础，并且估值低才能股息率高，这样的公司其实很稀缺。

4、估值的高低是自由市场定价和交易出来的，天下没有免费的午餐，市场不会平白无故给公司低估值，估值低必然是有内在原因。长期低估值的公司要不就是低增长、要不就是商业模式有瑕疵，ROE 水平较低，或者公司治理有问题。当这些内在问题没有根本改善，紧靠分红高，就期望能把估值持续提升，股价不断上涨，这是不现实的，也不可能持续。

5、低估值、高分红与高增长三者长期是不可能三角。增长的两个来源：一是 ROE 的提升，二是靠资本投入的增加。当一个公司 ROE 的提升是靠自身能力的时候，长期增长就会比较乐观，市场就会给公司较高的估值； 当一个公司靠周期的价格因素提升 ROE 时候，市场不会给公司较高的估值，增长也不可长期持续。当一个公司靠资本投入支撑高增长时候，就不可能有高分红；而把盈利都用来分红的时候，当 ROE 不变的时候，也不可能会有高增长。因此，通过以上的分析，三者关系要辩证看待，不可能都期望同时发生。

6、当前经济还处于弱复苏态势，基础不稳，整体价格还比较低迷，海外情况也比较复杂，外需也不能期望太高。这些低估值的红利公司，大都是对国民经济和周期比较敏感的行业，也必然受到内外部压力影响和价格扰动，因此业绩也会受到影响。当业绩出现较大下滑

的时候，则分红的基础就成了无本之木，分红金额也必然会下降，股息率的稳定性也会受到考验，高分红也会被证伪。近期很多公司的年报已经看到这方面的负面影响，因此也需要防范业绩风险，不能一味只看分红。

2024 年一季度，我们减仓了部分新能源和消费公司，逢低继续加仓了部分 TMT 等科技公司，二季度我们继续看好三个方向：

一是跌幅比较大的医药板块，基本面扎实，竞争格局好，回报率优秀，医疗反腐，短空长多，有利于集中度提升和费用率下降，看好高端医疗器械、创新药等板块的反弹空间。一季度医药的业绩相对较弱，二季度以后业绩压力会减少较多，随着下半年基数降低和以医疗设备加大更新改造政策、支持创新药政策的兑现，业绩会高速增长，目前股价是偏左侧比较好的布局时机。

二是高成长性板块，我们最看好储能、逆变器（包括微逆）、部分光伏设备、海上风电、充电桩等细分子行业的机会，优选壁垒高，商业模式好，投入回报率高的公司进行投资。经历了 2023 年的大幅下跌，很多公司动态估值已经处于较低的范围，虽然业绩有所下修，但是经历去库存之后，未来增长依然乐观。近期海外数据已经企稳，去库存取得了较大的进展，二季度以后环比有较大恢复，全年能延续较好的增长态势。

三是科技创新板块，当期人工智能、智能驾驶、人形机器人、华为产业链、卫星互联网、低空经济等板块，符合产业发展趋势，未来部分公司也能兑现业绩。近期海外 AI 领域出现了突破的进展，带动了国内人工智能的热情，国家政策也会积极支持。虽然一季度短期涨幅较高，短期会有回调风险，但长期趋势还非常乐观，目前还是 0 到 1 的阶段，我们会布局真正能兑现业绩的人工智能应用领域、国产算力公司和国产替代的半导体设备公司。

我们的投资策略是长期投资于中国证券市场上最优秀的高质量公司，靠优秀公司创造的股东盈利来给投资者带来回报，不去参与市场短期博弈，坚持“高质量”和“逆向投资”两个核心原则。我们关注的是企业的核心竞争力、商业模式、公司的护城河、行业的壁垒、企业的管理层及机制文化、供求的格局，以及我们为此付出的价格是否过高。这些内在的优秀品质最终体现在财务状况上，就是长期能够创造高的 ROIC 和 ROE 水平，良好的自由现金流和分红比率。我们坚信只有这些优秀的公司才能穿越周期，才能最终给投资者带来实实在在的回报。也希望投资者与我们一路同行，克服短期的挫折和困难，长期坚持做难但正确的事情，对中国经济和中国的未来保持充分信心，共同实现我们的投资初心！

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 3 月 31 日，本基金份额净值 0.5313，本报告期份额净值增长率为-4.65%，

同期比较基准的增长率为 2.72%。

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 | 681,020,006.87 | 86.92 |
| | 其中：股票 | 681,020,006.87 | 86.92 |
| 2 | 固定收益投资 | 48,792,052.06 | 6.23 |
| | 其中：债券 | 48,792,052.06 | 6.23 |
| | 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 | 18,000,000.00 | 2.30 |
| | 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 | 32,833,390.38 | 4.19 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,883,962.14 | 0.37 |
| 8 | 合计 | 783,529,411.45 | 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 | 548,942,428.42 | 72.56 |
| 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 | 15,542.28 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 11,556.45 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 124,135,522.20 | 16.41 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,097.60 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 7,897,850.21 | 1.04 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 14,009.71 | 0.00 |
| 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 | 681,020,006.87 | 90.02 |

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 | 688677 | 海泰新光 | 1,162,612 | 64,873,749.60 | 8.58 |
| 2 | 688351 | 微电生理 | 2,074,138 | 53,927,588.00 | 7.13 |
| 3 | 605117 | 德业股份 | 588,900 | 53,012,778.00 | 7.01 |
| 4 | 688256 | 寒武纪 | 274,784 | 47,664,032.64 | 6.30 |
| 5 | 688212 | 澳华内镜 | 660,847 | 40,007,677.38 | 5.29 |
| 6 | 688032 | 禾迈股份 | 171,712 | 37,024,541.44 | 4.89 |
| 7 | 300820 | 英杰电气 | 703,442 | 36,332,779.30 | 4.80 |
| 8 | 688498 | 源杰科技 | 287,644 | 35,955,500.00 | 4.75 |
| 9 | 300624 | 万兴科技 | 379,700 | 35,555,108.00 | 4.70 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 10 | 688108 | 赛诺医疗 | 2,797,775 | 33,097,678.25 | 4.37 |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|

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 | 48,792,052.06 | 6.45 |
| 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 | 48,792,052.06 | 6.45 |

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 | 019727 | 23 国债 24 | 242,000 | 24,523,219.18 | 3.24 |
| 2 | 019709 | 23 国债 16 | 240,000 | 24,268,832.88 | 3.21 |

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

本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

本基金合同尚无国债期货投资政策。

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

本基金合同尚无国债期货投资评价。

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 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

本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 475,838.97 |

| | | |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 2,257,210.99 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 150,912.18 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,883,962.14 |

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 | 1,618,502,482.53 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 23,944,178.15 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 218,561,413.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,423,885,247.68 |

§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 | 20240101-20240331 | 380,536,806.51 | 0.00 | 0.00 | 380,536,806.51 | 26.73% |

产品特有风险

虽然本基金的优选方法将可能会对基金资产的增值带来超额回报，但由于信息来源的不足、滞后或错误，导致基金管理人在判断宏观经济、行业周期及上市公司赢利预期产生偏差，使得投资者将面临本基金特有风险。

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) 中国证监会批准新世纪优选分红混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新世纪优选分红混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 中国证监会关于核准新世纪基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (四) 《新华优选分红混合型证券投资基金基金合同》

- (五)《新华优选分红混合型证券投资基金托管协议》
- (六)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (七)更新的《新华优选分红混合型证券投资基金招募说明书》
- (八)《新华优选分红混合型证券投资基金产品资料概要》(更新)
- (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
- (十一)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

二〇二四年四月十九日