

# 新沃创新领航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：新沃基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十四日

## § 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	新沃创新领航混合
交易代码	010570
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 24 日
报告期末基金份额总额	75,626,030.15 份
投资目标	本基金主要投资于创新领航主题的股票，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，本基金通过优选个股，进行积极的组合优化，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要通过分析国内外宏观经济运行状况、财政和货币政策、产业政策环境以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间各类资产相对收益率的基础上，动态优化调整国内依法发行上市的股票、债券、现金等大类资产的配置。本基金非现金基金资产的 80%需投资于创新领航主题的股票。本基金所指的“创新领航”主题涵盖了把创新发展作为应对环境变化、增强发展动力、把握主动权的发展之策，实现关键核心技术自主可控、推动产品和产业向价值链中高端跃升、甚至引领行业发展新方向的优质上市企业。其他主要投资策略还包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略、存托凭证投资策略和融资业务投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+ 中证综合债指数收

	益率×30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。	
基金管理人	新沃基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新沃创新领航混合 A	新沃创新领航混合 C
下属分级基金的交易代码	010570	010571
报告期末下属分级基金的份额总额	20,871,082.92 份	54,754,947.23 份

### § 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）	
	新沃创新领航混合 A	新沃创新领航混合 C
1. 本期已实现收益	-1,083,812.03	-2,713,975.91
2. 本期利润	1,369,093.27	3,473,258.22
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0621	0.0604
4. 期末基金资产净值	11,371,661.65	29,275,456.38
5. 期末基金份额净值	0.5449	0.5347

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

新沃创新领航混合 A

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	14.23%	1.78%	11.56%	1.09%	2.67%	0.69%
过去六个月	-2.97%	1.79%	10.50%	0.87%	-13.47%	0.92%
过去一年	-15.95%	1.78%	8.50%	0.76%	-24.45%	1.02%
过去三年	-51.77%	1.75%	-7.91%	0.76%	-43.86%	0.99%

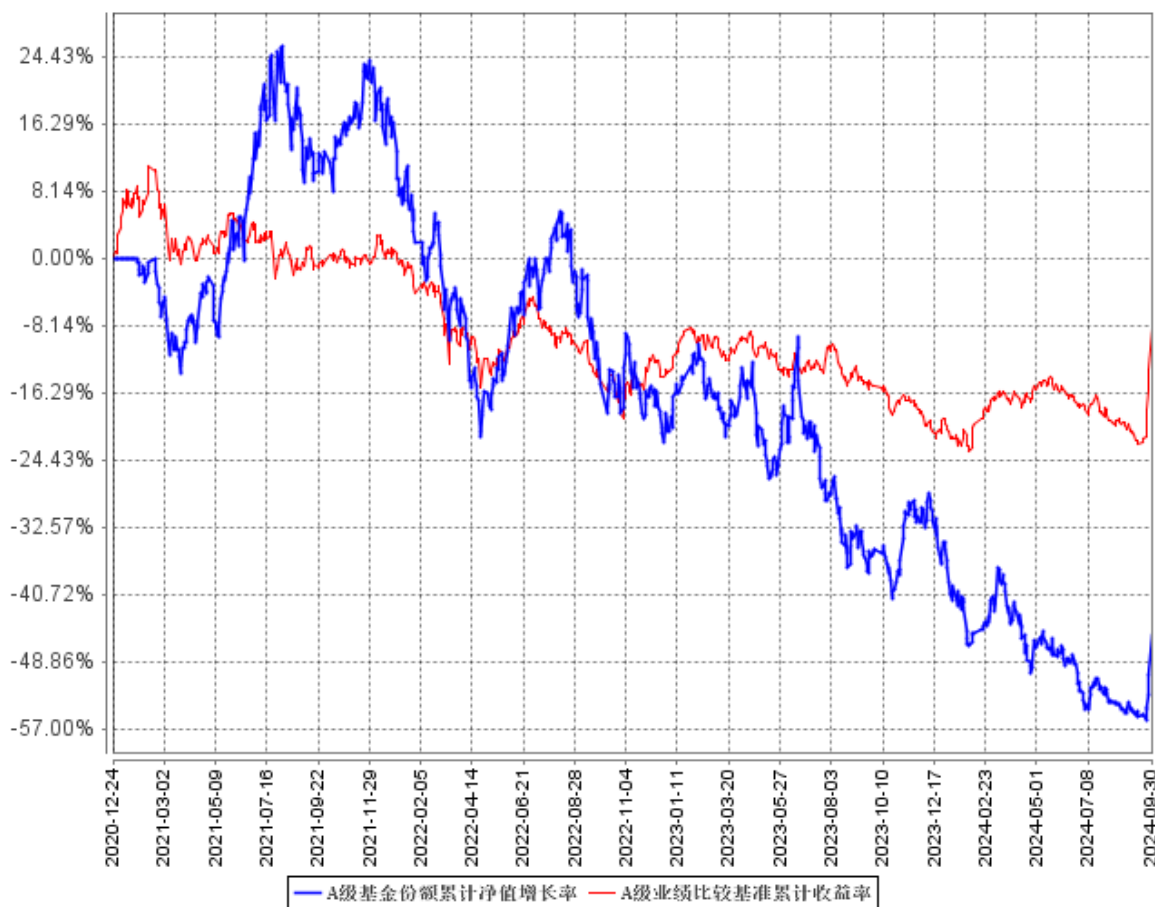
自基金合同生效起至今	-45.51%	1.73%	-8.33%	0.79%	-37.18%	0.94%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

新沃创新领航混合 C

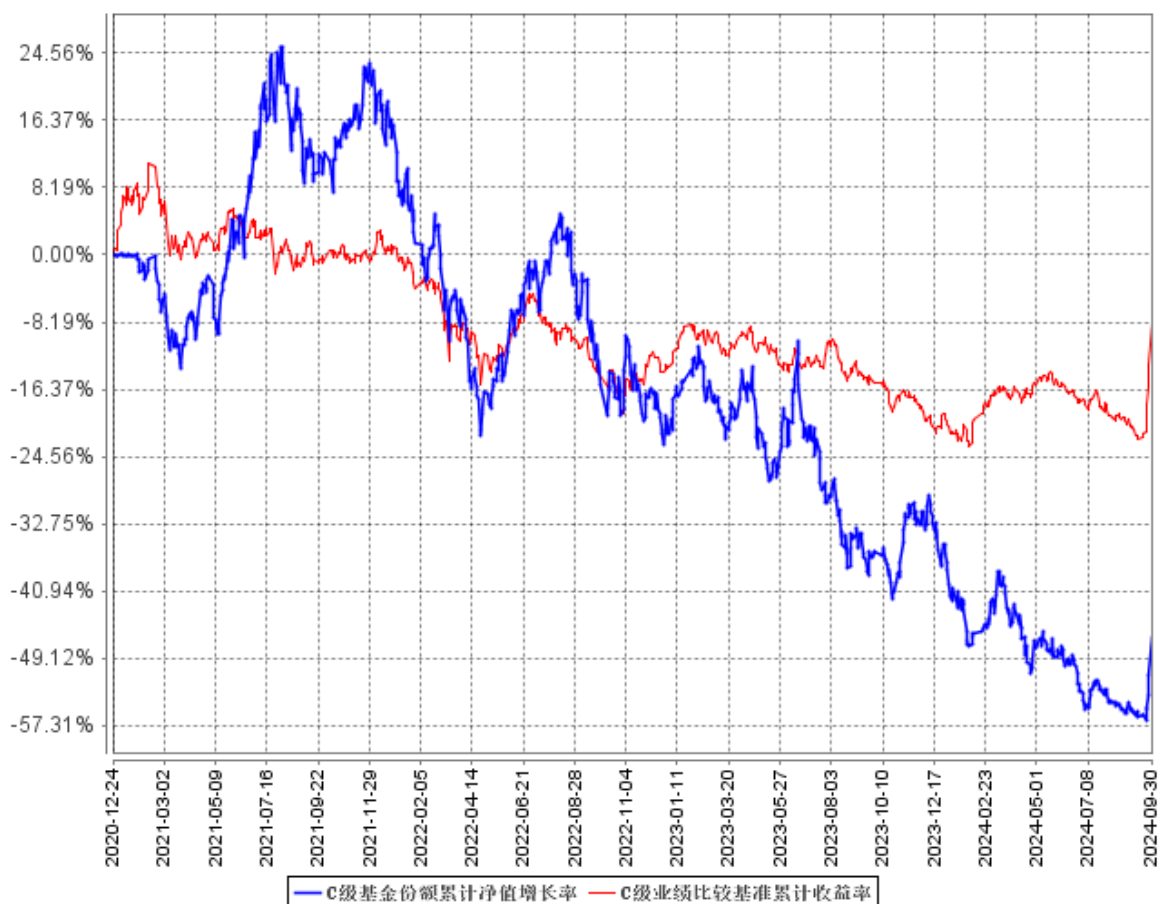
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.08%	1.78%	11.56%	1.09%	2.52%	0.69%
过去六个月	-3.22%	1.79%	10.50%	0.87%	-13.72%	0.92%
过去一年	-16.36%	1.78%	8.50%	0.76%	-24.86%	1.02%
过去三年	-52.49%	1.75%	-7.91%	0.76%	-44.58%	0.99%
自基金合同生效起至今	-46.53%	1.73%	-8.33%	0.79%	-38.20%	0.94%

### 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

A级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



C级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 2020 年 12 月 24 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		
陈乐华	本基金的基金经理、公司副总经理兼投资总监	2020 年 12 月 24 日	2024 年 7 月 12 日	16 年	中央财经大学金融学硕士，中国籍。2007 年 7 月至 2010 年 5 月任职于中信建投证券，担任研究发展部经理；2010 年 5 月至 2016 年 10 月任职于华宝兴业基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理、高级分析师等职务；2016 年 11 月至 2018 年 8 月任职于北信

					瑞丰基金管理有限公司，担任基金经理；2018 年 9 月加入新沃基金管理有限公司，先后担任研究部总监、总经理助理、公司副总经理兼投资总监，同时担任基金经理，现担任公司专户投资经理。
刘腾飞	本基金的基金经理、投资研究部总经理助理	2021 年 12 月 14 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，现担任投资研究部总经理助理、基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《新沃基金管理有限公司公平交易管理办法》，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实，确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。从事后监控角度上，定期对组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日）的季度公平性交易分析评估，对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异进行分析。公司定期对公平交易制度的遵守

和相关业务流程的执行情况进行检查，季度公平交易报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制定了《异常交易监控管理办法》对各类异常交易的情形进行了界定，并制定相应的监控方法与识别、报告、处理程序。

本报告期内，公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发生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交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度我国宏观经济下行压力依然较大，工业、投资、消费增长势头均有所减弱，制造业 PMI 指数持续处于收缩区间，价格水平处于低位，PPI 同比数据持续为负。内需不足对经济的拖累加剧，但出口表现出一定韧性。另一方面，美国当地时间 9 月 17 日美联储议息会议决定降息 50bp，美国正式开启降息周期。在此背景下我国政策空间进一步打开，预期后续一系列逆周期、跨周期调节政策将落地，对市场信心起到一定支撑作用。

从资本市场来看，三季度市场探底回升，各大指数与行业板块普涨。报告期内，上证指数涨 12.44% 收于 3336.50，深证成指涨 19.00% 收于 10529.76，中证 A50 涨 18.66%，沪深 300 涨 16.07%，中证红利指数涨 6.43%，创业板指涨 29.21%，科创 50 涨 22.51%，万得全 A 涨 17.68%。行业方面（中信一级行业指数），非银金融、综合金融、房地产、消费者服务、计算机涨幅靠前，石油石化、煤炭、电力及公用事业、农林牧渔、纺织服装涨幅较小。

报告期内，本基金采用自上而下的投资方法，重点关注符合经济发展趋势与政策引导方向的产业，在行业均衡配置的基础上，重点布局板块内具有较高增长潜力的公司，特别是那些具备技术创新实力与核心竞争壁垒，并且估值处于较低或合理水平的优质标的。在中长期，我们继续看好半导体芯片、高端装备制造等方向。我们将继续积极寻找具有超额收益的行业及个股，力争为持有人带来较好的投资回报。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末新沃创新领航混合 A 基金份额净值为 0.5449 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.23%；截至本报告期末新沃创新领航混合 C 基金份额净值为 0.5347 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.08%；同期业绩比较基准收益率为 11.56%。

## 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 7 月 1 日至 2024 年 9 月 30 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	36,070,962.00	88.29
	其中：股票	36,070,962.00	88.29
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	4,741,333.14	11.61
8	其他资产	42,740.16	0.10
9	合计	40,855,035.30	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	310,277.00	0.76
B	采矿业	1,093,809.00	2.69
C	制造业	26,148,310.75	64.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	277,635.00	0.68
E	建筑业	643,467.00	1.58
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	350,844.00	0.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,528,996.25	6.22
J	金融业	3,223,573.00	7.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,117,058.00	2.75
M	科学研究和技术服务业	376,992.00	0.93
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	36,070,962.00	88.74

### 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	300661	圣邦股份	25,900	2,460,500.00	6.05
2	603606	东方电缆	40,000	2,206,800.00	5.43
3	605117	德业股份	21,100	2,145,448.00	5.28
4	002241	歌尔股份	69,300	1,571,031.00	3.87
5	688099	晶晨股份	20,275	1,426,346.25	3.51
6	603160	汇顶科技	17,000	1,189,320.00	2.93
7	603986	兆易创新	13,100	1,157,647.00	2.85
8	300763	锦浪科技	13,200	1,098,240.00	2.70
9	002992	宝明科技	22,200	1,090,242.00	2.68

10	688981	中芯国际	13,717	822,882.83	2.02
----	--------	------	--------	------------	------

#### 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

宁波东方电缆股份有限公司（股票代码：603606.SH）因董事会运作不规范、独立性存在不足和相关信息披露不准确，中国证券监督管理委员会宁波监管局于 2024 年 9 月 2 日对其采取责令改正的行政监管措施并记入证券期货市场诚信档案。

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	42,740.16
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	42,740.16

### 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

项目	新沃创新领航混合 A	新沃创新领航混合 C
报告期期初基金份额总额	24,016,135.03	61,694,635.81
报告期期间基金总申购份额	256,197.19	1,045,248.49
减：报告期期间基金总赎回份额	3,401,249.30	7,984,937.07
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	20,871,082.92	54,754,947.23

## § 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

本报告期内，本基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

本基金报告期内不存在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

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创新领航混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《新沃创新领航混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新沃创新领航混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《关于申请募集注册新沃创新领航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 10 月 24 日