

国新国证优选配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 日

基金管理人：国新国证基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 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 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国新国证优选配置 6 个月持有混合发起（FOF）	
基金主代码	015813	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 08 月 23 日	
报告期末基金份额总额	44,914,765.48 份	
投资目标	本基金在努力控制风险和保持充足流动性的基础上，通过合理的资产配置和精选优质基金，力求降低投资组合的波动性，力争获取基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金通过对宏观经济、政策导向、产业趋势、资金利率、资本市场、基金公司、基金产品以及基金经理等方面的深入分析评估，采用“自上而下”动态调整大类资产配置和“自下而上”优选基金相结合的投资策略，在努力控制风险和保持充足流动性的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+中债综合全价（总值）指数收益率×85%	
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。	
基金管理人	国新国证基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国新国证优选配置 6 个月持有混合发起（FOF）A	国新国证优选配置 6 个月持有混合发起（FOF）C
下属分级基金的交易代码	015813	015814

报告期末下属分级基金的 份额总额	44,744,698.48 份	170,067.00 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 (2023 年 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日)	
	国新国证优选配置 6 个月持有混合发 起 (FOF) A	国新国证优选配置 6 个月 持有混合发起 (FOF) C
1. 本期已实现收益	-475,788.10	-1,779.48
2. 本期利润	-842,845.26	-3,053.20
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0171	-0.0180
4. 期末基金资产净值	43,419,675.77	164,421.06
5. 期末基金份额净值	0.9704	0.9668

注：(1) 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。

(2) 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。

(3) 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

#### 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

###### 国新国证优选配置 6 个月持有混合发起 (FOF) A 净值表现

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	-1.74%	0.28%	-0.57%	0.13%	-1.17%	0.15%
过去六个月	-3.05%	0.26%	-0.54%	0.12%	-2.51%	0.14%
过去一年	-2.20%	0.24%	0.22%	0.14%	-2.42%	0.10%
自基金合同 生效起至今	-2.96%	0.23%	-1.46%	0.14%	-1.50%	0.09%

###### 国新国证优选配置 6 个月持有混合发起 (FOF) C 净值表现

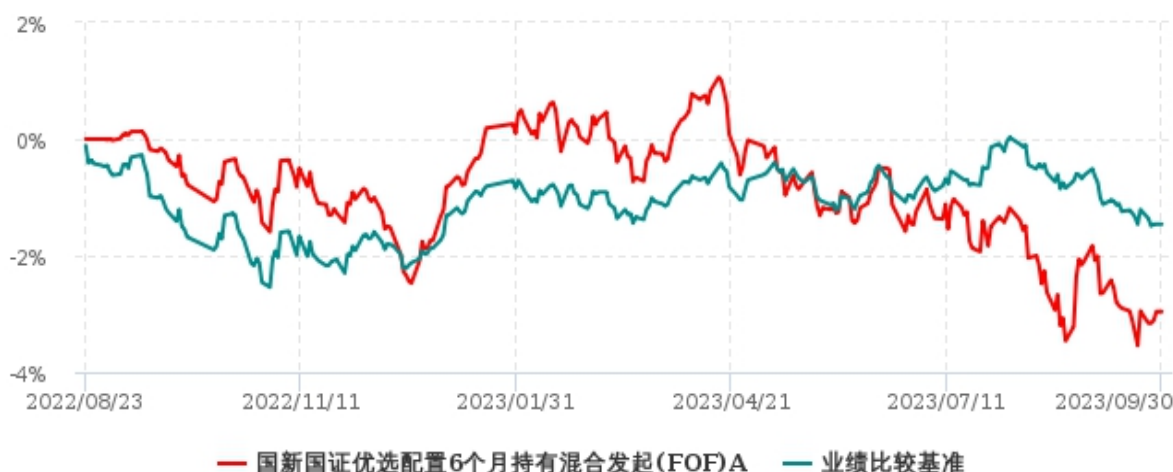
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-1.83%	0.28%	-0.57%	0.13%	-1.26%	0.15%

过去六个月	-3.19%	0.26%	-0.54%	0.12%	-2.65%	0.14%
过去一年	-2.52%	0.24%	0.22%	0.14%	-2.74%	0.10%
自基金合同生效起至今	-3.32%	0.23%	-1.46%	0.14%	-1.86%	0.09%

### 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

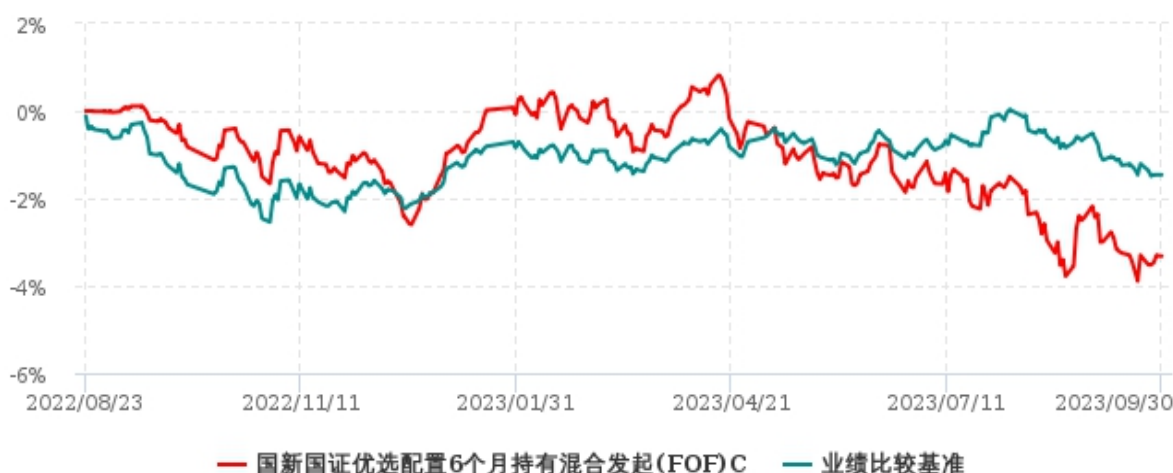
国新国证优选配置6个月持有混合发起(FOF)A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年08月23日-2023年09月30日)



国新国证优选配置6个月持有混合发起(FOF)C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年08月23日-2023年09月30日)



注：本基金的基金合同自2022年8月23日起生效。根据基金合同的规定，自本基金合同生效日起6个月内基金的投资比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

## § 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		
范贵龙	本基金的基金经理、FOF 投资部负责人	2022-08-23	-	14 年	范贵龙, 武汉大学金融学硕士, 特许金融分析师 (CFA), 金融风险管理师 (FRM), 14 年证券从业经验。2020 年 3 月加入国新国证基金管理有限公司 (原华融基金管理有限公司, 下同), 现任 FOF 投资部负责人。2022 年 8 月 23 日起任国新国证优选配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 的基金经理。历任中国建设银行股份有限公司西安新城支行客户经理、国务院发展研究中心信息网金融部研究员、国新证券股份有限公司 (原华融证券股份有限公司) 市场研究部研究员、资产管理二部投资经理助理、基金业务部基金经理、国新国证基金管理有限公司权益投资部负责人、国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金和国新国证新锐灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注: 1. 对基金的首任基金经理, 其“任职日期”为基金合同生效日, “离任日期”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》及行业协会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

截止本报告期末, 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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规规定及《国新国证优选配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 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》，建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对证券交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内基金管理人管理的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交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，政府围绕扩大内需、提振信心出台了一系列政策措施，随着政策效果的显现，经济出现企稳迹象。先行指标 PMI 走出持续 5 个月的收缩状态，9 月 PMI 恢复到 50.2。PPI 同比增速降幅连续收窄、CPI 同比涨幅由负转正。生产端，8 月份工业增加值增速回升到 4.5%，工业企业收入增速也有所恢复。需求端，除投资增速仍面临压力外，消费和出口也有所好转。海外方面，美国经济保持韧性，美联储加息节奏虽有调整，但美债利率持续走高。

三季度，股票市场震荡走低、债券市场高位波动，沪深 300 下跌 3.46%、科创 50 下跌 11.35%、上证 50 上涨 0.65%、偏股基金下跌 6.53%，股票型和混合型基金的表现逊于指数。

报告期内，本基金在满足投资者申购赎回和基金合同要求的基础上，积极应对市场变化，提高

操作的灵活性，把握市场调整过程中的结构性机会。本基金始终坚持持有人利益优先的原则，根据宏观环境、市场变化和被投资基金情况动态调整持仓结构，权益类资产占比总体上保持中高水平。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国新国证优选配置 6 个月持有混合发起(FOF)A 基金份额净值为 0.9704 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.74%，同期业绩比较基准收益率为-0.57%；截至报告期末国新国证优选配置 6 个月持有混合发起(FOF)C 基金份额净值为 0.9668 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.83%，同期业绩比较基准收益率为-0.57%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，在报告期内未触及《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

### § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	39,858,876.77	88.06
3	固定收益投资	2,225,692.85	4.92
	其中：债券	2,225,692.85	4.92
	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	900,000.00	1.99
	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	2,263,467.98	5.00
8	其他资产	14,050.97	0.03
9	合计	45,262,088.57	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

本基金本报告期末投资股票。

##### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	2,225,692.85	5.11
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	2,225,692.85	5.11

### 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	019703	23 国债 10	10,000	1,008,030.14	2.31
2	019688	22 国债 23	7,000	710,781.34	1.63
3	019694	23 国债 01	5,000	506,881.37	1.16

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。

### 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

本基金本报告期末投资资产支持证券。

### 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

本基金本报告期末投资贵金属。

### 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

本基金本报告期末投资权证。

### 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

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括股指期货。

## 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

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

## 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监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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

本基金本报告期末投资股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,050.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,050.97

### 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转股期间的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资股票。

### 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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 基金中基金

### 6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	002091	华泰柏瑞新利混合 C	契约型开放式	1,930,362.47	2,912,916.97	6.68	否
2	000914	中加纯债债券	契约型开放式	2,498,057.96	2,599,728.92	5.96	否
3	004011	华泰柏瑞鼎利混合 C	契约型开放式	1,472,295.11	2,260,561.91	5.19	否
4	001123	鹏华弘利混合 C	契约型开放式	1,407,150.94	2,127,049.36	4.88	否
5	100018	富国天利增长债券 A/B	契约型开放式	1,570,067.60	2,115,352.08	4.85	否
6	217022	招商产业债券 A	契约型开放式	1,196,915.09	2,066,234.52	4.74	否

7	519782	交银裕隆纯 债债券 A	契约型开放 式	1,555,629.69	2,057,942.52	4.72	否
8	013449	广发景宁纯 债 C	契约型开放 式	1,805,546.70	1,991,518.01	4.57	否
9	161115	易方达岁丰 添利债券 (LOF)A	契约型开放 式	1,241,250.36	1,975,077.57	4.53	否
10	420102	天弘永利债 券 B	契约型开放 式	1,585,161.36	1,870,965.95	4.29	否

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023 年 07 月 01 日至 2023 年 09 月 30 日	其中：交易及持有基金管理人以及 管理人关联方所管理基金产生的 费用
当期交易基金产生的申购 费(元)	598.81	-
当期交易基金产生的赎回 费(元)	10,600.08	-
当期持有基金产生的应支 付销售服务费(元)	11,025.86	-
当期持有基金产生的应支 付管理费(元)	83,161.14	5,255.67
当期持有基金产生的应支 付托管费(元)	18,664.66	875.98

注：（1）当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。根据本基金合同的约定，本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的其他基金份额的部分不收取管理费，本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的其他基金份额的部分不收取托管费。

（2）根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

## 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金持有的基金在报告期未发生重大影响事件。

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

	国新国证优选配置 6 个月持有混合发起 (FOF) A	国新国证优选配置 6 个月持有混合发起 (FOF) C
报告期期初基金份额总额	51,963,038.41	170,072.00
报告期期间基金总申购份额	1,030.53	-
减：报告期期间基金总赎回份额	7,219,370.46	5.00
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	44,744,698.48	170,067.00

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	国新国证优选配置 6 个月持有混合发起 (FOF) A	国新国证优选配置 6 个月持有混合发起 (FOF) C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,003,200.32	-
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	10,003,200.32	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	22.36	-

注：本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

## § 9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理	10,003,200.32	22.27%	10,003,200.32	22.27%	2022.8.23~2025.8.22

人固有资金						
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	-	
合计	10,003,200.32	22.27%	10,003,200.32	22.27%	2022.8.23~2025.8.22	

## § 10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 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	2023.08.14~2023.09.30	10,003,200.32	-	-	10,003,200.32	22.27%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在持有人大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，存在流动性风险，且在特定市场条件下，若基金管理人及时变现基金资产，存在基金净值波动风险。							

### 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、《国新国证优选配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》
- 3、《国新国证优选配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》
- 4、《国新国证优选配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》

- 5、本基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

## 11.2 存放地点

上述备查文件存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。

## 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.crsfund.com.cn](http://www.crsfund.com.cn)）查阅。

国新国证基金管理有限公司  
二〇二三年十月二十五日