
新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)
(原新华惠鑫分级债券型证券投资基金转型而来)
2017年第1季度报告
2017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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年四月二十一日

§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 2017 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。

自 2017 年 1 月 24 日新华惠鑫分级债券型证券投资基金之惠鑫 B 终止上市起，原新华惠鑫分级债券型证券投资基金名称变更为新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）。原新华惠鑫分级债券型证券投资基金报告期自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 24 日止，新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）报告期自 2017 年 1 月 25 日至 2017 年 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

基金简称	新华惠鑫债券(LOF)
基金主代码	164302
交易代码	164302
基金运作方式	上市开放式基金
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 日
报告期末基金份额总额	93,398,222.50 份
投资目标	在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的资产管理，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。首先，

	本基金管理人将采用战略性与战术性相结合的大类资产配置策略，在基金合同规定的投资比例范围内确定各大类资产的配置比例。在此基础之上，一方面综合运用久期策略、收益率曲线策略以及信用策略进行固定收益类资产投资组合的构建；另一方面通过定量与定性相结合的分析方法，积极进行新股申购、定向增发、可转债转股等投资操作，在新股流通后择机卖出以提高基金的整体收益水平。
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

2.2 新华惠鑫分级债券型证券投资基金

基金简称	新华惠鑫分级债券	
基金主代码	164302	
基金运作方式	契约型开放式基金	
基金合同生效日	2014年1月24日	
报告期末基金份额总额	305,969,149.20份	
投资目标	在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的资产管理，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金的投资策略主要包括：大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。首先，本基金管理人将采用战略性与战术性相结合的大类资产配置策略，在基金合同规定的投资比例范围内确定各大类资产的配置比例。在此基础之上，一方面综合运用久期策略、收益率曲线策略以及信用策略进行固定收益类资产投资组合的构建；另一方面通过定量与定性相结合的分析方法，积极进行新股申购、定向增发、可转债转股等投资操作，在新股流通后择机卖出以提高基金的整体收益水平。	
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	新华惠鑫分级债券 A	新华惠鑫分级债券 B
下属两级基金的交易代码	164303	150161

报告期末下属两级基金的份 额总额	9,908,494.15 份	296,060,655.05 份
---------------------	----------------	------------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2017年1月25日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	14,349,815.96
2.本期利润	823,859.10
3.加权平均基金份额本期 利润	0.0015
4.期末基金资产净值	93,860,677.59
5.期末基金份额净值	1.0050

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。

3.1.2 新华惠鑫分级债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2017年1月1日-2017年1月24日)
1.本期已实现收益	2,087,609.87
2.本期利润	2,553,138.21
3.加权平均基金份额本期 利润	0.0083
4.期末基金资产净值	541,894,608.54
5.期末基金份额净值	1.7710

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 新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

（报告期：2017年1月25日-2017年3月31日）

3.2.1.1 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

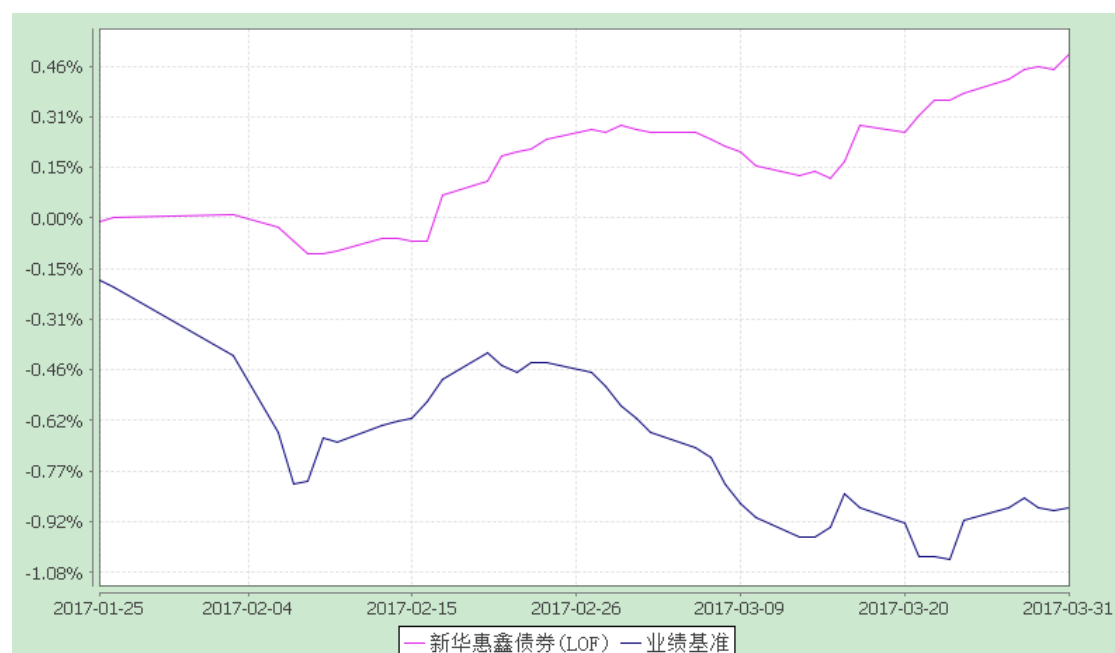
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.51%	0.04%	-0.89%	0.08%	1.40%	-0.04%

注：1、本基金业绩比较基准为：中债新综合指数（全价），

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.1.2 自基金转型以来基金份额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

新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2017年1月25日-2017年3月31日)



注：1、本基金转换日为2017年1月24日，在份额转换基准日日终，以份额转换后1.000元的基金份额净值为基准，根据惠鑫A份额和惠鑫B份额的转换比例对转换基准日登记在册的基金份额实施转换。自2017年1月25日起，本基金的基金名称变更为“新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）”。

2、本基金本报告期内各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.2 新华惠鑫分级债券型证券投资基金

（报告期：2017年1月1日-2017年1月24日）

3.2.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%	0.06%	-0.36%	0.07%	1.04%	-0.01%

1、本基金业绩比较基准为：中债新综合指数（全价），

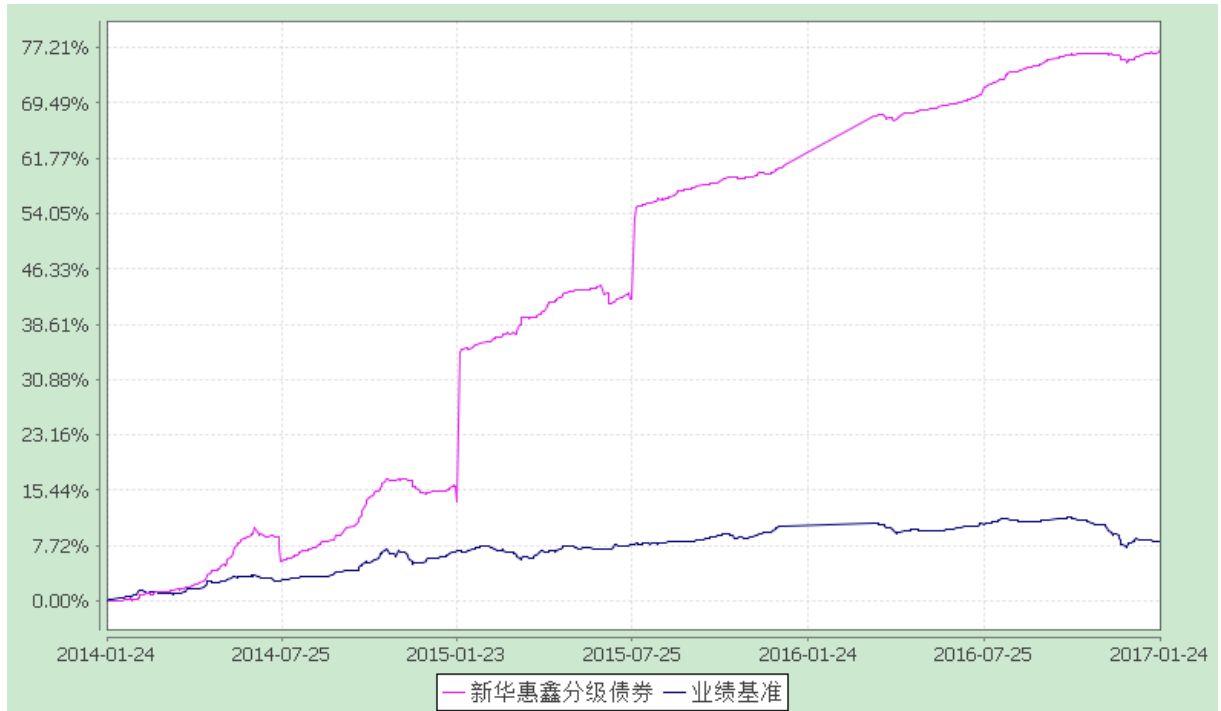
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2.2 自基金转型以来基金份额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

新华惠鑫分级债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年1月24日至2017年1月24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		
于泽雨	本基金基金经理，新华基金管理股份有限公司投资总监助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放	2014-01-24	-	8	经济学博士，8年证券从业经验。历任华安财产保险公司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理，于2012年10月加入新华基金管理股份有限公司。现任新华基金管理股份有限公司投资总监助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金经理、新华信用增强债券型证券投资基金基金经理、新华双利债券型证券投资基金基金经理、新华恒稳添利债券

	债券型 证券投资 基金基 金经理、 新华信用 增益债 券型证 券投资 基金基 金基金 经理、 新华信 用增强 债券型 证券投 资基金 基金基 金基金 经理、 新华双 利债券 型证券 投资基 金基金 经理、 新华恒 稳添利 债券型 证券投 资基金 基金基 金基金 经理。				型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--------------

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。

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》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)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

报告期内，基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定。

基金管理人对旗下所有投资组合间连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明：债券同向交易频率偏低；股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断，即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大，结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，本报告期内，未发生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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年一季度，工业企业利润增速提高，带动经济基本面短期企稳；CPI 和 PPI 冲高回落，通胀预期逐步降温，但工业品价格仍处在高位可能带动企业补库存和增加投资；货币政策受海外因素制约，稳中偏紧。

利率债市场上，收益率波动上行，短端升幅约 30bp，长端的 10 年期国债上升 18bp 至 3.28%，10 年期国开债上升 36bp 至 4.06%，期限利差持续维持在较低水平。信用债市场上，各期限评级债券均有 30-40bp 的反弹，且信用利差上行。

基金运作方面，尽管收益率持续上行，但整体上风险大于机会，且长久期债券收益率的吸引力有限，因此本基金没有选择主动进攻，而是维持了较低的杠杆比例和久期，力求保证组合的流动性和收益的稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金份额净值为 1.0050 元。自本基金份额转换日次日（2017 年 1 月 25 日）起至本报告期期末，本基金份额净值增长率为 0.51%，同期业绩比较基准收益率为-0.89%。

截止本基金份额转换日（2017 年 1 月 24 日），原新华惠鑫分级债券型证券投资基金份额净值为 1.771 元。自本报告期期初（2017 年 1 月 1 日）起至本基金份额转换日，原新华惠鑫分级债券型证券投资基金份额净值增长率为 0.68%，同期业绩比较基准收益率为-0.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年二季度，金融监管将持续发力使得负债端成本逐渐增加，利率底部有抬升倾向；而经济基本面弱势起稳、财政支出空间有限、货币政策中性稳健将对债市形成主要支撑。在以上因素交叉作用下，收益率大概率将维持在高位区间震荡。

债券投资方面，考虑到短端信用债绝对收益水平回升至历史中位数附近，较强的估值吸引力意味着相对稳定的套息空间，本基金将着力配置具备内在价值的短久期信用债。重点关注省国资委百分之百控股、负债率相对适中、有一定竞争力的国有企业与行业龙头企业发行的债券。同时，随着利率底部抬升，长久期利率债的吸引力逐渐显现，本基金将择机配置长久期利率债。合理控制杠杆，在充分保证组合流动性的同时提高收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期末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的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

（报告期：2017年1月25日-2017年3月31日）

5.1.1 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	固定收益投资	93,311,119.43	96.31

	其中：债券	93,311,119.43	96.31
	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	-	-
	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	914,739.08	0.94
7	其他各项资产	2,660,242.31	2.75
8	合计	96,886,100.82	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.3 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。

5.1.4 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	367,110.10	0.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,999,400.00	6.39
	其中：政策性金融债	5,999,400.00	6.39
4	企业债券	80,723,900.20	86.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	217,985.30	0.23
8	其他	6,002,723.83	6.40
9	合计	93,311,119.43	99.41

5.1.5 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	124459	13 随州 01	100,000	8,371,000.00	8.92
2	124402	13 丹投 01	88,910	7,287,063.60	7.76
3	1480192	14 宁国债	59,990	6,415,930.50	6.84
4	122644	12 铁岭债	120,000	6,078,000.00	6.48

5	100408	10 农发 08	60,000	5,999,400.00	6.39
---	--------	----------	--------	--------------	------

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 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。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末尚无股指期货投资政策。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末尚无国债期货投资政策。

5.1.10.2 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。

5.1.10.2 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的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。

5.1.11.2 本报告期内，本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定。

5.1.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	871.19
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	2,511,048.48
5	应收申购款	100,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	48,322.64
8	其他	-
9	合计	2,660,242.31

5.1.11.4 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	110033	国贸转债	145,935.70	0.16
2	110035	白云转债	72,049.60	0.08

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无股票投资。

5.1.11.6 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。

5.2 新华惠鑫分级债券型证券投资基金

(报告期：2017年1月1日-2017年1月24日)

5.2.1 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	固定收益投资	364,301,158.73	66.95
	其中：债券	364,301,158.73	66.95
	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	163,595,314.44	30.06
	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	4,278,058.06	0.79
7	其他各项资产	11,964,680.76	2.20
8	合计	544,139,211.99	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.3 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。

5.2.4 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	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	268,831,136.90	49.61
5	企业短期融资券	50,230,000.00	9.27
6	中期票据	-	-
7	可转债	216,282.10	0.04
8	其他	45,023,739.73	8.31
9	合计	364,301,158.73	67.23

5.2.5 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	1480131	14 巴国资	300,000	32,544,000.00	6.01
2	1480163	13 随州 02	300,000	32,481,000.00	5.99
3	1480499	14 高安城投债	300,000	32,187,000.00	5.94
4	124043	12 深立业	250,000	25,305,000.00	4.67
5	125367	14 美兰 01	250,000	25,027,904.11	4.62

5.2.6 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。

5.2.7 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。

5.2.8 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。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 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。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末尚无股指期货投资政策。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末尚无国债期货投资政策。

5.2.10.2 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。

5.2.10.2 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。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的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。

5.2.11.2 本报告期内，本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定。

5.2.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	91.94
2	应收证券清算款	350.58
3	应收股利	-
4	应收利息	11,964,238.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,964,680.76

5.2.11.4 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	110033	国贸转债	145,834.10	0.03

2	110055	白云转债	70,448.00	0.01
---	--------	------	-----------	------

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无股票投资。

5.2.11.6 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

6.1 新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

单位：份

基金转型起始日基金份额总额	541,894,607.68
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	22,479,708.22
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	470,976,093.40
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	93,398,222.50

6.2 新华惠鑫分级债券型证券投资基金

单位：份

项目	新华惠鑫分级债券A	新华惠鑫分级债券B
本报告期初基金份额总额	11,511,486.03	296,060,655.05
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,602,991.88	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	9,908,494.15	296,060,655.05

注：根据《新华惠鑫分级债券型证券投资基金三年期届满转型后基金名称变更及转换日等事项的公告》，2017年1月24日为《新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金合同》生效后3年期届满，转换为上市开放式基金(LOF)。在份额转换基准日日终，以份额转换后1.000元的基金份额净值为基准，根据惠鑫A份额和惠鑫B份额的转换比例对转换基准日登记在册的基金份额实施转换。转换后，惠鑫A的基金份额净值调整为1.0000元，惠鑫A的转换比例

为1.015797260，转换变动份额为156,527.05份。惠鑫B的基金份额净值调整为1.0000元，惠鑫B的转换比例为1.796353477，转换变动份额为235,768,931.43份。本次惠鑫A，惠鑫B实施基金份额转换及开放申购与赎回结束后，本基金的总份额为541,894,607.68份。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期末未持有本基金。

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

7.2 新华惠鑫分级债券型证券投资基金

7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期末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 新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

8.1.1 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	20170126-20170306	-	437,380,917.49	419,152,000.00	18,228,917.49	19.52%

8.1.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内未有影响投资者决策的其他重要信息。

8.2 新华惠鑫分级债券型证券投资基金

8.2.1 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	20170101-20170125	-	0.00	243,482,657.00	0.00	0.00%

8.2.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内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)中国证监会批准新华惠鑫分级债券型证券投资基金募集的文件
- (二)关于申请募集新华惠鑫分级债券型证券投资基金之法律意见书
- (三)新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)基金合同
- (四)新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)托管协议
- (五)新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)登记结算服务协议
- (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《新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》
- (八)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程
- (九)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (十)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
- (十一)新华惠鑫分级债券型证券投资基金三年期届满转型后基金名称变更及转换日等事项的公告
- (十二)关于申请新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)变更注册的法律意见书

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

二〇一七年四月二十一日