

新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

2018年半年度报告

2018年6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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2018 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	38
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.11 投资组合报告附注.....	38
8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	40
8.3 末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
9 开放式基金份额变动	41
10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	错误!未定义书签。
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误!未定义书签。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误!未定义书签。
10.8 其他重大事件	45
11 影响投资者决策的其他重要信息	46
12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
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	
报告期末基金份额总额	8,355,190.66 份	
下属分级基金的基金简称	新华惠鑫债券(LOF)A	新华惠鑫债券(LOF)C
下属分级基金的交易代码	005673	164302
报告期末下属分级基金的份额总额	-份	8,355,190.66 份

2.2 基金产品说明

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。在此基础上,一方面综合运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、信用策略等进行债券投资组合的构建;另一方面采用自下而上的个股精选策略,精选具有持续成长性且估值相对合理,同时股价具有趋势向上的股票构建权益类资产投资组合,以提高基金的整体收益水平。
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率×60%+中债国债总全价指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	郭明
	联系电话	010-68779688	010-66105798
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95588
传真		010-68779528	010-66105799

注册地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	400010	100140
法定代表人	陈重	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区太平桥大街17号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年1月1日至2018年6月30日）	
	新华惠鑫债券(LOF)A	新华惠鑫债券(LOF)C
本期已实现收益	-	18,376.67
本期利润	-	-473,625.01
加权平均基金份额本期利润	-	-0.0339
本期加权平均净值利润率	-	-3.29%
本期基金份额净值增长率	-	-5.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	新华惠鑫债券(LOF)A	新华惠鑫债券(LOF)C
期末可供分配利润	-	3,503,463.47
期末可供分配基金份额利润	-	0.42
期末基金资产净值	-	8,205,038.55
期末基金份额净值	-	0.9820
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
	新华惠鑫债券(LOF)A	新华惠鑫债券(LOF)C
基金份额累计净值增长率	-	-1.80%

注：1、截至本报告期末，本基金 A 类基金无份额。

2、本期已实现收益指本期利息收、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、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（例如基金申购书会费等），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 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

新华惠鑫债券(LOF)A

截至本报告期末,本基金 A 类基金无份额。

新华惠鑫债券(LOF)C

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
过去一个月	-2.35%	0.68%	-0.73%	0.13%	-1.62%	0.55%
过去三个月	-4.28%	0.46%	-0.82%	0.14%	-3.46%	0.32%
过去六个月	-5.21%	0.42%	-0.47%	0.13%	-4.74%	0.29%
过去一年	-3.25%	0.32%	-1.77%	0.10%	-1.48%	0.22%
自合同生效起至今	-1.80%	0.27%	-3.49%	0.10%	1.69%	0.17%

3.2.2 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

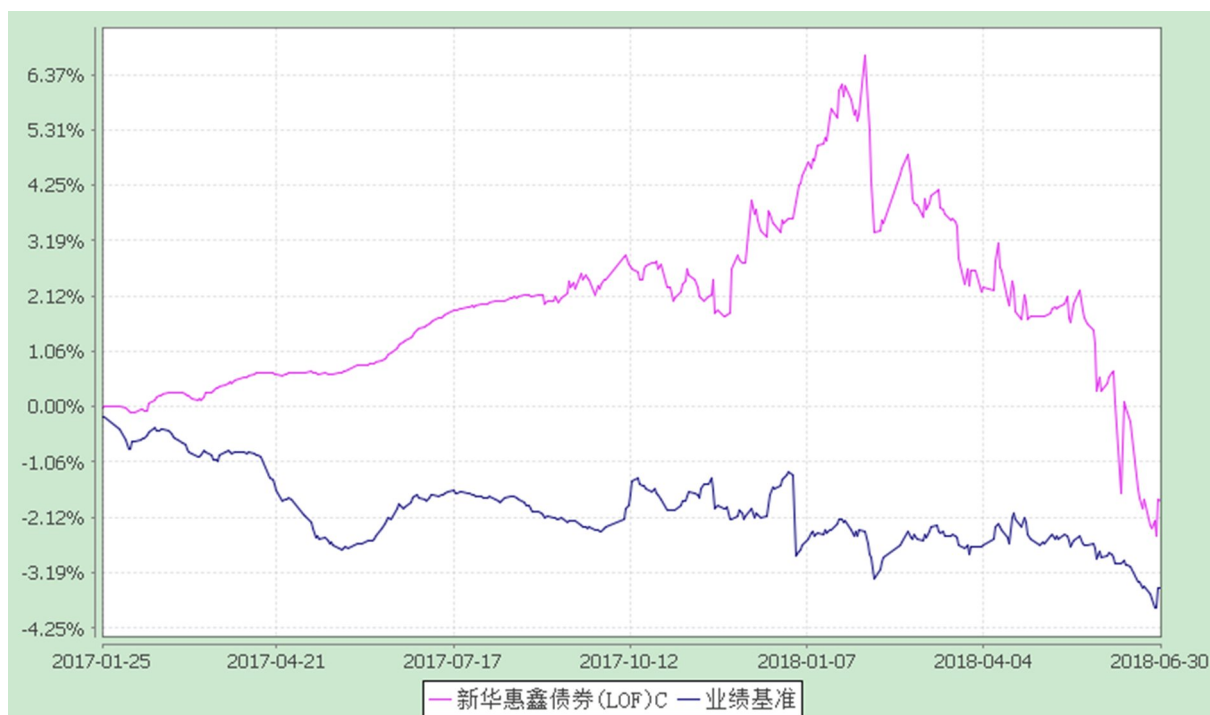
(2017年1月25日至2018年6月30日)

新华惠鑫债券(LOF)A



注：截至本报告期末,本基金 A 类基金无份额。

新华惠鑫债券(LOF)C



注：本基金本报告期内各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于2004年12月9日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至2018年6月30日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华精选低波动股票型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫锐混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金、新华华丰灵活配置混合型证券投资基金和新华安享惠钰定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2014-01-2	-	10	经济学博士,历任华安财产保险公

	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、新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理、新华安享惠钰定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华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。	4			司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理。
--	--	---	--	--	------------------------

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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制度》。制度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。

场内交易，投资指令统一由交易部下达，并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度，严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中，对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易，交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议，由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易部向银行间市场或交易所对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年，经济增速整体上出现短期回落。固定资产投资增速持续下滑，房地产投资增速在土地购置费支撑下稳中向好，工业企业利润增速较前期小幅回升，内生经济仍旧具备韧性；进出口增速整体延续震荡复苏态势，出口略有萎靡，进口持续扩张，但中美贸易争端影响开始显现，对美出口增速下降；受食品项拖累，CPI同比增速处于偏低水平，油价推动PPI超预期回升，上下游企业盈利能力继续分化；货币政策开始强调“松紧适度”，对流动性表述有所放宽，央行两次定向降准，银行间市场流动性宽裕，R007下降至2.5%。

债券市场方面，在“去杠杆”和商业银行“表外业务收缩”的双重影响下，实体经济活跃度有所回落，融资需求受到抑制，特别是在中美贸易战逐步升级后，市场对经济前景的预期更加悲观，长久期利率债受到市场追捧；表外业务收缩使得企业的融资环境变差，违约风险增加，市场对信用债的投资趋于谨慎，利率债投资需求结构性增加。具体看，利率债收益率大幅下行，短端下行约50-80bp，

长端的 10 年期国债下行 43bp 至 3.47%，10 年期国开债下行 62bp 至 4.25%，期限利差小幅走阔。信用债收益率走势严重分化，高评级信用债收益率下行约 50bp，中低评级信用债收益率持续上行。

基金操作方面，本基金对表外业务收缩带来的影响估计得比较重，认为在融资环境收紧的情况下，利率下行的可能性不大，可以利用偏紧的融资环境享受更高的利息收益，于是侧重于投资短期企业债以获得利息收益。但实际上，由于经济回落压力和风险偏好降低，利率债收益率明显下行。本基金欠配长长期利率债而没有享受到价差收益。

股票投资方面，本基金对经济长周期不悲观，并且认为投资的低估值品种估值并未完全修复，所以在过去数月采取持有不动的策略。但因为市场在利空因素和悲观预期影响下出现了调整，该策略使基金净值出现了较大回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9820 元，本报告期份额净值增长率为-5.21%，同期比较基准的增长率为-0.47%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内宏观经济大概率面临较大压力，房地产销售同比增速持续放缓，地方政府债务严查和城投平台融资收紧制约基建投资效率，中美贸易战持续升级或对进出口产生负面影响。宏观去杠杆任务已取得阶段性成效，货币政策边际放松将成为下一阶段主导债市的关键。另一方面，我们认为需要关注政策对冲措施发力后经济和市场环境的变化：首先，在表外业务收缩导致社融增速断崖式下降的情况下，预期表内贷款业务将明显扩张，债券发行也有可能提速；其次，“去杠杆变为稳杠杆”后，实体经济的投融资活动也可能恢复活跃。

债券投资方面，未来一段时间本基金还是以持有短期限企业债获取利息收益为主。考虑到资金成本持续下降，同时部分中等评级信用债被错杀，短端中等评级信用债估值和安全性更具吸引力，有相对稳定的套息空间。重点关注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，将继续关注长久期利率债的收益率出现阶段性冲高的机会，本基金将逢高参与长久期利率债，合理控制杠杆，在充分保证组合流动性的同时提高收益。

股票投资方面，由于持有的标的总体上属于低估值、类债券品种，且企业未来经营向好，对估值修复有支持和保障，所以本基金接下来主要选择继续持有这些品种。在市场已经调整到较低位置的情况下，结合持有品种的低估值属性，持有策略面临的潜在风险有限。未来主要靠时间来消化目前的调整。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部门、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

二、基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部门相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部门的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；

- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

四、交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

五、监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资管理部门问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2018 年 5 月 08 日起至 2018 年 6 月 30 日，连续 38 个工作日基金资产净值不足五千万
元。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）的管理人——新华基金管理股份有限公司

在新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新华基金管理股份有限公司编制和披露的新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）2018年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	119,401.20	93,506.10
结算备付金		28,075.40	495,595.58
存出保证金		5,738.09	9,011.41
交易性金融资产	6.4.7.2	9,216,014.80	14,349,277.60
其中：股票投资		2,134,044.90	2,980,142.00
基金投资		-	-
债券投资		7,081,969.90	11,369,135.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-	200,000.00
应收证券清算款		400,000.00	101,690.22
应收利息	6.4.7.4	154,910.56	225,068.39
应收股利		-	-
应收申购款		3,100.00	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	470.00	-
资产总计		9,927,710.05	15,474,149.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		1,100,000.00	900,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		473,206.49	121,867.27
应付管理人报酬		5,239.04	12,135.88
应付托管费		1,496.89	3,467.37
应付销售服务费		2,993.74	6,934.80
应付交易费用	6.4.7.6	3,880.95	16,189.77
应交税费		360.53	-
应付利息		260.82	1,353.72
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	135,233.04	460,000.00
负债合计		1,722,671.50	1,521,948.81
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.8	4,701,575.08	7,578,343.65
未分配利润	6.4.7.9	3,503,463.47	6,373,856.84
所有者权益合计		8,205,038.55	13,952,200.49
负债和所有者权益总计		9,927,710.05	15,474,149.30

注：1、截至本报告期末,本基金 A 类基金无份额。

2、报告截止日 2018 年 6 月 30 日, 本基金 C 类份额净值 0.9820 元, 基金 C 类份额 8,355,190.66 份。

6.2 利润表

会计主体：新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月25日(基 金合同生效日)至201 7年6月30日
一、收入		-200,023.01	4,978,893.58
1.利息收入		235,872.45	6,105,189.29
其中：存款利息收入	6.4.7.10	2,701.06	16,417.08

债券利息收入		221,553.06	5,521,747.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,618.33	567,024.83
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,762.18	12,621,444.78
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-9,695.34	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	19,161.12	12,621,444.78
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.13	5,296.40	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-492,001.68	-13,747,740.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	41,344.04	-
减：二、费用		273,602.00	2,195,221.45
1. 管理人报酬		50,644.18	795,625.78
2. 托管费		14,469.77	227,321.66
3. 销售服务费		28,939.57	522,690.72
4. 交易费用	6.4.7.16	3,244.88	11,842.33
5. 利息支出		20,051.96	401,149.43
其中：卖出回购金融资产支出		20,051.96	401,149.43
6.税金及附加		400.56	-
7. 其他费用	6.4.7.17	155,851.08	236,591.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-473,625.01	2,783,672.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-473,625.01	2,783,672.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,578,343.65	6,373,856.84	13,952,200.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-473,625.01	-473,625.01

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,876,768.57	-2,396,768.36	-5,273,536.93
其中：1.基金申购款	23,544,971.12	19,082,867.17	42,627,838.29
2.基金赎回款	-26,421,739.69	-21,479,635.53	-47,901,375.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,701,575.08	3,503,463.47	8,205,038.55
项目	上年度可比期间		
	2017年1月25日（基金合同生效日）至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	304,927,062.96	236,967,545.58	541,894,608.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,783,672.13	2,783,672.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-199,791,457.68	-155,241,980.99	-355,033,438.67
其中：1.基金申购款	157,757,175.56	124,387,733.73	282,144,909.29
2.基金赎回款	-357,548,633.24	-279,629,714.72	-637,178,347.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	105,135,605.28	84,509,236.72	189,644,842.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：陈重，主管会计工作负责人：张宗友，会计机构负责人：徐端骞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华惠鑫分级债券型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1320号《关于核准新华惠鑫分级债券型证券投资基金募集的批复》的批准，由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于2013年12月26日至2014年1月20日通过销售机构公开发售，其中惠鑫A自2014年

1月8日至2014年1月20日进行发售,惠鑫B自2013年12月26日至2014年1月7日进行发售。首次募集资金总额726,085,320.66元,其中募集资金产生利息243,443.20元,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2014]37100006号验资报告予以验证。2014年1月24日经向证监会办理基金备案手续,基金合同正式生效。基金合同生效日的基金总份额为726,085,320.66份,其中新华惠鑫分级债券型基金A级(以下简称“惠鑫A”)430,024,631.26份,含认购资金利息折合份额73,387.32份,新华惠鑫分级债券型基金B级(以下简称“惠鑫B”)296,060,689.40份,含认购资金利息折合份额170,055.88份。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金合同》以及《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》,本基金自基金合同生效后3年期届满时自动转换为上市开放式基金(LOF),名称变更为“新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)”。本基金的转换基准日为2017年1月24日,在转换基准日日终,以份额转换后1.0000元的基金份额净值为基础,新华惠鑫分级债券型证券投资基金之惠鑫A(基金简称:惠鑫A,基金代码:164303)、新华惠鑫分级债券型证券投资基金之惠鑫B(场内简称:惠鑫B,基金代码:150161)的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)的份额。

根据《关于新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)增加A类份额并修改基金合同和托管协议的公告》,自2018年2月14日起对本基金增加手续申购赎回费且仅支持场外申购赎回业务的A类基金份额,并对本基金法律文件进行相应修改。本基金增加A类基金份额类别后,将分设A类和C类两类基金份额,将分别设置对应的基金代码,并分别公布基金资产净值和份额净值,并按照不同费率计提销售服务费用。本基金A类基金份额代码为005673(新增基金份额类别),本基金C类基金份额代码为164302(现有基金份额类别)。

根据《新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》及《新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的债券(包含国债、央票、政策性金融债及所有非国家信用的固定收益类金融工具)、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金是债券型基金,投资于国债、中央银行票据、银行同业存款、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、可转换公司债(含分离交易的可转换公司债券)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、回购等债券资产占基金资产比例不低于80%;权证投资占基金资产净值的比例为0-3%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、

应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于2018年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制,根据实际发生的交易和事项,按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与上年度一致,会计政策与上年度一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从2008年9月19日起,调整证券(股票)交易印

花税征收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》的规定：2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 号）、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140 号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2 号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56 号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90 号）的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，证券投资基金在运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照现行规定缴纳增值税及附加税费。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定：对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时，对个人持股 1 年以内（含 1 年）的，上市公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	119,401.20
定期存款	-
其他存款	-
合计	119,401.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,681,458.41	2,134,044.90	-547,413.51	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,567,112.09	2,575,583.30	8,471.21
	银行间市场	4,507,242.47	4,506,386.60	-855.87
	合计	7,074,354.56	7,081,969.90	7,615.34
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	9,755,812.97	9,216,014.80	-539,798.17	

6.4.7.3 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	13.50
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	13.68
应收债券利息	154,883.38
应收资产支持证券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	154,910.56

注：结算备付金利息包含存出保证金利息。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
其他应收款	470.00
待摊费用	-
合计	470.00

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,090.63
银行间市场应付交易费用	2,790.32
合计	3,880.95

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	-
预提费用	135,233.04
合计	135,233.04

6.4.7.8 实收基金

新华惠鑫债券(LOF)A

截至本报告期末，本基金A类基金无份额。

新华惠鑫债券(LOF)C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	13,467,985.51	7,578,343.65
本期申购	41,843,020.42	23,544,971.12
本期赎回（以“-”号填列）	-46,955,815.27	-26,421,739.69
本期末	8,355,190.66	4,701,575.08

6.4.7.9 未分配利润

新华惠鑫债券(LOF)A

截至本报告期末，本基金 A 类基金无份额。

新华惠鑫债券(LOF)C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,193,279.60	-819,422.76	6,373,856.84
本期利润	18,376.67	-492,001.68	-473,625.01
本期基金份额交易产生的变动数	-2,748,514.27	351,745.91	-2,396,768.36
其中：基金申购款	22,213,449.97	-3,130,582.80	19,082,867.17
基金赎回款	-24,961,964.24	3,482,328.71	-21,479,635.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,463,142.00	-959,678.53	3,503,463.47

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	1,777.12
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	923.94
其他	-
合计	2,701.06

注：结算备付金利息包含存出保证金利息。

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	402,435.20
减：卖出股票成本总额	412,130.54
买卖股票差价收入	-9,695.34

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	60,132,754.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	58,522,642.87
减：应收利息总额	1,590,950.31
买卖债券差价收入	19,161.12

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,296.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,296.40

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-492,001.68
——股票投资	-433,966.56
——债券投资	-58,035.12
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-492,001.68

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	41,295.20
转换费收入	48.84
合计	41,344.04

6.4.7.16 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	814.63
银行间市场交易费用	2,430.25
合计	3,244.88

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	95,561.46
债券账户维护费	18,000.00
汇划手续费	1,898.04
其他	720.00
合计	155,851.08

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至2018年6月30日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、发起人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比区间无通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比区间无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比区间无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月25日（基金合同生效日） 至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例
恒泰证券股份有限公司	1,200,000.00	1.93%	19,100,000.00	18.42%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月25日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	50,644.18	795,625.78
其中：支付销售机构的客户维护费	15,831.94	38,427.84

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.7%/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月25日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,469.77	227,321.66

注：基金托管费按前一日的基金资产净值0.20%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华惠鑫债券(LOF)A	新华惠鑫债券(LOF)C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	7,728.09	7,728.09
恒泰证券股份有限公司	-	866.31	866.31
新华基金管理股份有限公司	-	4,554.77	4,554.77
合计	-	13,149.17	13,149.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017年1月25日（基金合同生效日）至2017年6月30日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华惠鑫债券(LOF)A	新华惠鑫债券(LOF)C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	16,875.39	16,875.39
恒泰证券股份有限公司	-	1,183.20	1,183.20
新华基金管理股份有限公司	-	398,436.01	398,436.01
合计	-	416,494.60	416,494.60

注：1、本基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.4%年费率计提。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.4%/当年天数。

2、本报告期列示的应支付的销售服务费为当期计提金额。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期末管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

新华惠鑫债券(LOF)A

报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

新华惠鑫债券(LOF)C

报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月25日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	119,401.20	1,777.12	775,262.07	14,982.45

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无收益分配事项。

6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

截止2018年6月30日，本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600221	海航控股	2018-01-10	重大资产重组	2.61	2018-07-20	2.91	292,100.00	963,930.00	762,381.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至2018年6月30日，本基金从事交易所市场债券正回购形成的卖出回购金融资产款余额为1,100,000.00元，于2018年7月3日全部到期。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金

管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
A-1	605,520.00	-
A-1 以下	508,209.60	-
未评级	3,911,642.40	-
合计	5,025,372.00	-

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
AAA	715,434.00	-
AAA 以下	1,341,163.90	-
未评级	-	-
合计	2,056,597.90	-

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份

额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

6.4.13.4.2 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.2.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	119,401.20	-	-	-	119,401.20
结算备付金	28,075.40	-	-	-	28,075.40
存出保证金	5,738.09	-	-	-	5,738.09
交易性金融资产	7,081,969.90	-	-	2,134,044.90	9,216,014.80
应收证券清算款	-	-	-	400,000.00	400,000.00

应收利息	-	-	-	154,910.56	154,910.56
应收申购款	-	-	-	3,100.00	3,100.00
其他资产	-	-	-	470.00	470.00
资产总计	7,235,184.59	-	-	2,692,525.46	9,927,710.05
负债					
卖出回购金融资产款	1,100,000.00	-	-	-	1,100,000.00
应付赎回款	-	-	-	473,206.49	473,206.49
应付管理人报酬	-	-	-	5,239.04	5,239.04
应付托管费	-	-	-	1,496.89	1,496.89
应付销售服务费	-	-	-	2,993.74	2,993.74
应付交易费用	-	-	-	3,880.95	3,880.95
应付利息	-	-	-	260.82	260.82
其他负债	-	-	-	135,233.04	135,233.04
应交税费	-	-	-	360.53	360.53
负债总计	1,100,000.00	-	-	622,671.50	1,722,671.50
利率敏感度缺口	6,135,184.59	-	-	2,069,853.96	8,205,038.55

6.4.13.4.2.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点		
	其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末
		2018年6月30日	2017年12月31日
	市场利率上升 25.00 bp	增加约 0	-
	市场利率下降 25.00 bp	增加约 0	-

注：本基金管理人运用 XRisk Suite 风险控制系统对本基金投资组合中的银行存款、结算备付金、存出保证金和债券类资产做出以上利率风险的敏感性分析

6.4.13.4.3 外汇风险

本基金的所有资产与负债均以人民币计价,因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.4 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金

所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.4.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,134,044.90	26.01	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,081,969.90	86.31	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,216,014.80	112.32	-	-

6.4.13.4.4.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深300指数上升1%		
	其他市场变量不变,沪深300指数下降1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
	沪深300指数上升1%	增加约2	-
	沪深300指数下降1%	减少约2	-

注：本基金管理人运用 XRisk suite 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价格风险的敏感性分析。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,134,044.90	21.50
	其中：股票	2,134,044.90	21.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,081,969.90	71.34
	其中：债券	7,081,969.90	71.34
	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	147,476.60	1.49
8	其他各项资产	564,218.65	5.68
9	合计	9,927,710.05	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	732,180.00	8.92
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	763,539.00	9.31

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	638,325.90	7.78
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	2,134,044.90	26.01

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600221	海航控股	292,100	762,381.00	9.29
2	600166	福田汽车	360,000	730,800.00	8.91
3	601998	中信银行	102,790	638,325.90	7.78
4	600717	天津港	100	753.00	0.01
5	601339	百隆东方	100	575.00	0.01
6	002585	双星新材	100	534.00	0.01
7	600350	山东高速	100	405.00	0.00
8	600219	南山铝业	100	271.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期无累计买入金额超出期初(或期末)基金资产净值 2%或前 20 名的股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	601998	中信银行	402,435.20	2.88
---	--------	------	------------	------

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	412,130.54
卖出股票的收入（成交）总额	402,435.20

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,911,342.40	35.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,000,300.00	12.19
	其中：政策性金融债	1,000,300.00	12.19
4	企业债券	1,849,373.50	22.54
5	企业短期融资券	605,520.00	7.38
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	715,434.00	8.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,081,969.90	86.31

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	189923	18 贴现国债 23	24,000	2,382,960.00	29.04

2	170410	17 农发 10	10,000	1,000,300.00	12.19
3	113011	光大转债	7,050	715,434.00	8.72
4	041752009	17 兴荣控 股 CP001	6,000	605,520.00	7.38
5	124389	PR 资水务	9,400	572,836.00	6.98

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,738.09
2	应收证券清算款	400,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	154,910.56
5	应收申购款	3,100.00
6	其他应收款	470.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	564,218.65

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大证券	715,434.00	8.72

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600221	海航控股	762,381.00	9.29	重大资产重组

7.12.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
新华惠鑫债券(LOF)A	-	-	-	-	-	-
新华惠鑫债券(LOF)C	396	21,098.97	258,675.00	3.10%	8,096,515.66	96.90%
合计	396	21,098.97	258,675.00	3.10%	8,096,515.66	96.90%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	谢国珍	834,561.26	9.99%
2	丁静	495,515.78	5.93%
3	李山治	340,678.33	4.08%
4	唐满红	270,000.00	3.23%
5	贾全虎	269,539.12	3.23%
6	中国石油天然气集团公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公	258,675.00	3.10%
7	叶玲	182,055.75	2.18%
8	马俊芬	180,294.97	2.16%
9	郑爱华	179,635.00	2.15%
10	赵銑宇	172,505.04	2.06%

新华惠鑫债券(LOF)C

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	谢国珍	834,561.26	9.99%
2	丁静	495,515.78	5.93%

3	李山治	340,678.33	4.08%
4	唐满红	270,000.00	3.23%
5	贾全虎	269,539.12	3.23%
6	中国石油天然气集团公司 企业年金计划—中国工商 银行股份有限公司	258,675.00	3.10%
7	叶玲	182,055.75	2.18%
8	马俊芬	180,294.97	2.16%
9	郑爱华	179,635.00	2.15%
10	赵銑宇	172,505.04	2.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	新华惠鑫债券(LOF)A	0.00	0.00%
	新华惠鑫债券(LOF)C	1,083.87	0.01%
	合计	1,083.87	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	新华惠鑫债券(LOF)A	0
	新华惠鑫债券(LOF)C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华惠鑫债券(LOF)A	0
	新华惠鑫债券(LOF)C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华惠鑫债券(LOF)A	新华惠鑫债券(LOF)C
基金合同生效日(2017年1月25日)基金份额总额	-	541,894,607.68
本报告期期初基金份额总额	-	13,467,985.51
本报告期基金总申购份额	-	41,843,020.42
减：本报告期基金总赎回份额	-	46,955,815.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	-	8,355,190.66

注：截至本报告期末,本基金A类基金无份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2018年5月21日,沈健先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理。

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

宏信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	282,080.00	70.09%	262.69	70.09%	-
海通证券	1	120,355.20	29.91%	112.09	29.91%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用28个交易席位，其中报告期内新增6个交易席位，退租0个交易席位。新增交易席位为：长江证券上海交易席位、长江证券深圳交易席位、广发证券上海交易席位、广发证券深圳交易席位、天风证券上海交易席位、天风证券深圳交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经济商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	5,900,000.00	9.47%	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	2,100,000.00	3.37%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	2,000,000.00	3.21%	-	-
恒泰证券	-	-	1,200,000.00	1.93%	-	-
西南证券	-	-	18,900,000.00	30.34%	-	-
中金证券	593,473.19	34.68%	13,100,000.00	21.03%	-	-
长江证券	-	-	4,000,000.00	6.42%	-	-
国信证券	199,880.00	11.68%	500,000.00	0.80%	-	-
国泰君安	206,500.00	12.07%	5,100,000.00	8.19%	-	-
海通证券	711,617.33	41.58%	9,500,000.00	15.25%	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)2017年第4季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2018-01-20
2	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在北京展恒基金销售股份有限公司开展费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2018-01-30
3	关于新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)增加A类份额并修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2018-02-05
4	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2018-02-08
5	新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)全文	公司网站	2018-03-09
6	新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2018-03-09
7	新华基金管理股份有限公司关于新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)修改基金合同的公告	证券日报、公司网站	2018-03-27
8	新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)基金合同和托管协议	公司网站	2018-03-27
9	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2018-03-28
10	新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)2017年年度报告	证券日报、公司网站	2018-03-30
11	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2018-03-30
12	新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)2018年第1季度报告	《证券日报》	2018-04-23
13	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2018-05-22
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加深圳众禄基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2018-05-24
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金2018年半年度资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、	2018-06-30

	公司网站	
--	------	--

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20180427-20180514	-	14,753,614.64	14,753,614.64	-	-
个人	1	20180502-20180508	-	19,659,884.01	19,659,884.01	-	-
产品特有风险							
<p>1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，自2018年2月14日起对本基金增加手续申购赎回费且仅支持场外申购赎回业务的A类基金份额，并对本基金法律文件进行相应修改。本基金增加A类基金份额类别后，将分设A类和C类两类基金份额，将分别设置对应的基金代码，并分别公布基金资产净值和份额净值，并按照不同费率计提销售服务费用。本基金C类基金份额代码为：164302，A类基金份额代码为：005673。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)募集的文件
- (二) 关于申请募集新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)之法律意见书
- (三) 新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)托管协议

- (四) 新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)基金合同
- (五) 新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则
- (六) 更新的《新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)招募说明书》
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (九) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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

二〇一八年八月二十八日