

新华增强债券型证券投资基金
2019 年半年度报告
2019 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：二〇一九年八月二十四日

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 2019 年 8 月 23 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 2019 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.....	12
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	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.11 投资组合报告附注.....	40
8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
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	42
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	47
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	新华增强债券型证券投资基金	
基金简称	新华增强债券	
基金主代码	002421	
交易代码	002421	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 4 月 13 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	35,819,264.71 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华增强债券 A	新华增强债券 C
下属分级基金的交易代码	002421	002422
报告期末下属分级基金的份额总额	24,188,027.07 份	11,631,237.64 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险并保持较高资产流动性的前提下，通过配置债券等固定收益类金融工具，追求基金资产的长期稳定增值，通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。
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，在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定的绝对收益。另外，本基金通过自下而上的个股精选策略，精选具有持续成长且估值相对合理的股票构建权益类资产投资组合，增加基金的获利能力，以提高整体的收益水平。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

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) 66105799
	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) 66105798
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	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	新华基金管理股份有限公司	北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座

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（2019年1月1日至2019年6月30日）	
	新华增强债券 A	新华增强债券 C
本期已实现收益	-8,603.80	-275,847.28
本期利润	-3,088,832.63	-838,003.38
加权平均基金份额本期利润	-0.0971	-0.0466
本期加权平均净值利润率	-8.59%	-4.18%
本期基金份额净值增长率	1.13%	0.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	新华增强债券 A	新华增强债券 C
期末可供分配利润	3,404,149.68	1,461,020.96
期末可供分配基金份额利润	0.1407	0.1256
期末基金资产净值	27,592,176.75	13,092,258.60
期末基金份额净值	1.1407	1.1256
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	

	新华增强债券 A	新华增强债券 C
基金份额累计净值增长率	14.07%	12.56%

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、对期末可供分配利润，采用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的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

新华增强债券 A

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	1.48%	0.28%	0.79%	0.10%	0.69%	0.18%
过去三个月	-0.20%	0.37%	-0.27%	0.14%	0.07%	0.23%
过去六个月	1.13%	0.45%	2.78%	0.14%	-1.65%	0.31%
过去一年	2.71%	0.38%	3.69%	0.15%	-0.98%	0.23%
过去三年	13.28%	0.27%	-3.99%	0.13%	17.27%	0.14%
自基金合同生效起至今	14.07%	0.26%	-5.45%	0.13%	19.52%	0.13%

新华增强债券 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	1.45%	0.28%	0.79%	0.10%	0.66%	0.18%
过去三个月	-0.27%	0.37%	-0.27%	0.14%	0.00%	0.23%
过去六个月	0.91%	0.45%	2.78%	0.14%	-1.87%	0.31%
过去一年	2.27%	0.38%	3.69%	0.15%	-1.42%	0.23%
过去三年	11.89%	0.27%	-3.99%	0.13%	15.88%	0.14%
自基金合同生效起至今	12.56%	0.26%	-5.45%	0.13%	18.01%	0.13%

注：1、本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

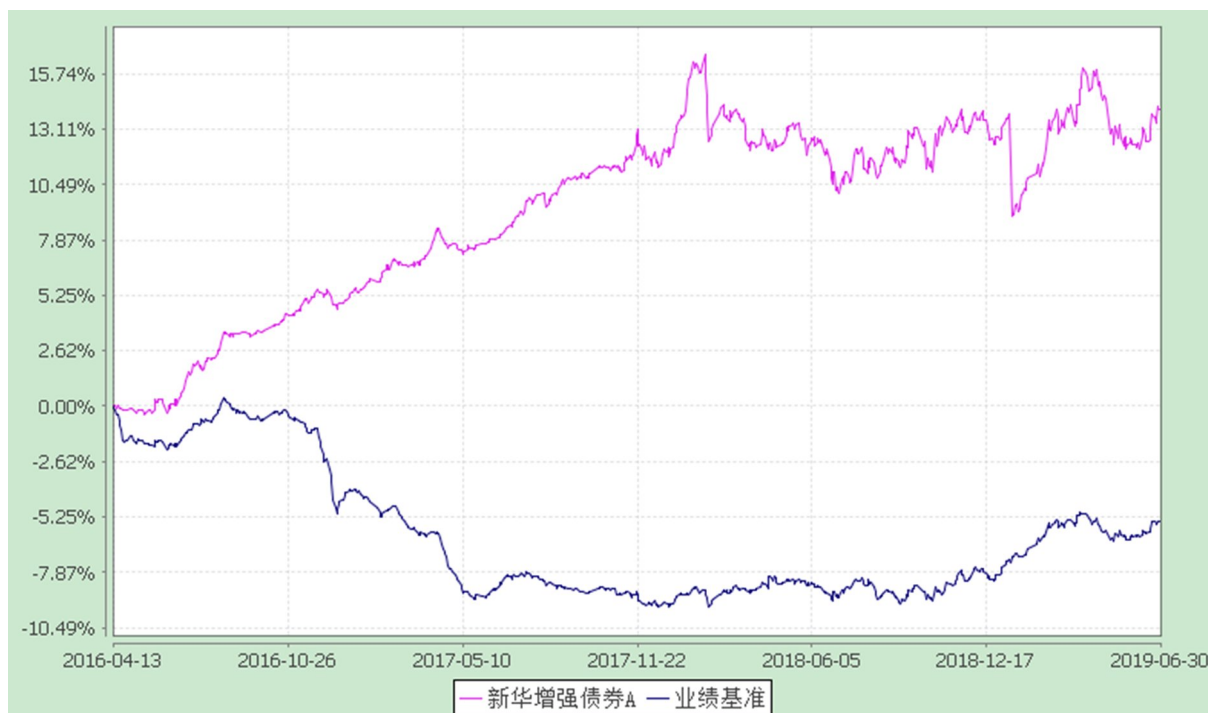
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华增强债券型证券投资基金

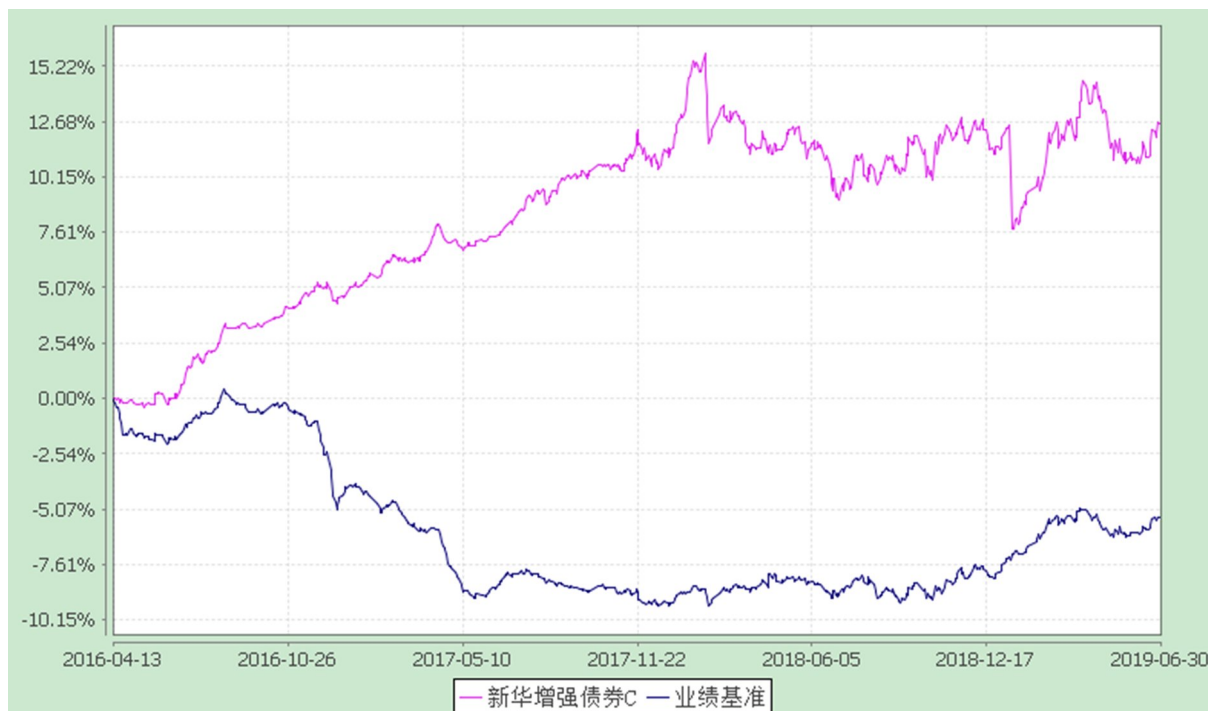
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 4 月 13 日至 2019 年 6 月 30 日)

新华增强债券 A



新华增强债券 C



注：1、本基金于 2016 年 4 月 13 日基金合同生效。

2、报告期内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 2019 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十四只开放式基金，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、新华鑫弘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、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华家盈双利混合型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金和新华鼎利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	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
李显君	本基金基金经理，新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理。	2016-07-08	-	11	工商管理及金融学硕士，历任国家科技风险开发事业中心研究员、大公国际资信评估有限公司评级分析师、中国出口信用保险公司投资主办、中国人寿资产管理有限公司研究员和账户投资经理，先后负责宏观研究、信用评级、策略研究、投资交易、账户管理等工作。

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增强债券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》、《新华增强债券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 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《证券投资基金管理有限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

2019 年上半年利率债整体呈现先跌后涨态势。年初至 4 月下旬收益率震荡走高，10 年期国债收益率上行约 28BP，10 年期国开债收益率上行约 37BP，收益率走熊主要来自于经济基本面的好转；从 4 月下旬开始，利率债进入牛途，自 4 月高点至 6 月底，10 年期国债收益率下行约 20BP，10 年期国开债收益率下行约 27BP，债牛启动主要来自于经济预期的变化。信用债收益率一季度小幅下行，高收益信用债下行速度较快，信用利差继续收窄，但从 4 月份开始信用债收益率出现一波上行，5 月份转向快速回落，5 月份中旬以后基本企稳；上半年城投债和地产债表现较优，低等级信用债风险偏好仍未明显上升，债券违约率仍高。

2019 年上半年股市整体呈现先涨后跌态势。一季度上证综指涨幅超过 20%，最高站上 3100 点，股市上涨的支撑因素包括：去杠杆转稳杠杆、货币政策和财政政策边际积极、中美贸易摩擦缓和、国家对资本市场的支持力度加大、流动性大幅改善、大部分行业 PE 处于中位数下方、企业减税政策落地等。二季度股市在 4 月初创下阶段性新高 3288 点后出现快速调整并一度下探至 2838 点，市场下跌源于先前乐观预期的理性下修：4 月中央政治局会议并未如同前两次会议一样提及“六稳”政策目标，表明逆周期调节政策进入观察期，其中货币政策变化较为显著，市场流动性大幅宽松预期落空；5 月经济数据再度回落，市场对经济复苏的乐观预期转变；中美贸易谈判黑天鹅的出现加速了市场调整。

基金操作方面，债券投资部分，2019 年上半年本基金债券组合配置采取子弹型结构，主要配置中短久期信用债，重点关注产权关系稳定、主营业务持续性好、盈利能力较强、各项财务指标健康、负债规模和负债率适中的信用债；股票投资部分，2019 年上半年本基金股票组合配置结构更趋集中化，更集中于看好的个股，重点关注各行业中具有长期竞争力的低估值、真成长的蓝筹和白马标的，并根据市场情绪和估值情况将股票仓位维持在适当水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.1407 元，本报告期份额净值增长率为 1.13%，

同期比较基准的增长率为 2.78%；本基金 C 类份额净值为 1.1256 元，本报告期份额净值增长率为 0.91%，同期比较基准的增长率为 2.78%。

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，债券投资部分，基本面来看，全球经济和贸易可能继续减速，中国在新一轮全球经贸规则重构中处于相对不利地位，进口增加将对国内下游需求形成竞争性冲击，货物贸易顺差收窄直接带来经济下行压力，全球经济下行带来中国出口减速，影响甚至可能大于贸易摩擦；国内方面，中国经济近年呈现 L 型增长，目前国内经济存在深层次问题和突出矛盾，在人口红利和制度红利消退后，旧经济模式副作用开始持续拖累经济，投资驱动增长模式举步维艰，经济增长压力仍大，国家层面的稳增长政策力度难以对冲经济负面因素引起的下行压力，政策见效的难度将越来越大，高质量发展之路需要兼顾短期经济增长和中期经济转型，进而需要在财政赤字、基建稳增长措施和减税之间艰难平衡；融资需求方面，我国仍是高债务经济体，去杠杆政策基调不变，很难看到从稳杠杆到全面加杠杆的政策转变；信用风险方面，本轮宽信用政策传导机制理顺前，无法带来信用债全面回暖，结构性信用风险依然存在，产业债信用下潜仍然需要非常谨慎。货币政策来看，汇率升值加货币宽松政策组合存在滋生资产泡沫风险，汇率适度贬值和稳健中性的货币政策可能是更优政策组合。整体来看，本基金认为下半年债市存在长牛基础，可重点关注长久期利率债和高等级信用债的投资机会。

股票投资部分，本基金认为如同经济结构转型一样，下半年股市投资机会也将是优胜劣汰。预计下半年股市结构化特征将更加明显，优质个股持续上涨和劣质个股出清将是市场主要特征。股市整体将更趋稳健，对抗外部风险的韧性将继续加强，暴涨暴跌现象将逐渐减少，以更具稳定更具持续性的方式来演绎发展。

基金操作上，下半年本基金将着重关注大类资产配置，债券投资方面，本基金将采取中短久期配置和长久期交易的策略，重点挖掘产权关系稳定、主营业务持续性好、盈利能力较强、各项财务指标健康、负债规模和负债率适中的中短久期、较高收益信用债，同时密切关注长端利率债的波段交易机会。股票投资方面，本基金将着重关注传统行业和成长性行业中具有长期竞争力的低估值标的，坚守价值投资理念，重点研究和跟踪核心标的，并结合市场整体情况做好仓位管理。此外，本基金将积极关注转债市场，重点关注二级市场上转股溢价率低、流动性好且正股估值低、业绩优异的大盘转债。

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

本报告期本基金从 2019 年 1 月 21 日至 2019 年 3 月 29 日连续四十五个工作日基金资产净值低于五千元,从 2019 年 4 月 22 日至 2019 年 6 月 28 日连续四十六个工作日基金资产净值低于五千元。

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增强债券型证券投资基金的托管过程中，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，新华增强债券型证券投资基金的管理人——新华基金管理股份有限公司在新华增强债券型证券投资基金的投资运作、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，新华增强债券型证券投资基金未进行利润分配。

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增强债券型证券投资基金 2019 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

2019 年 8 月 23 日

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：新华增强债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	193,657.52	978,026.45
结算备付金		998.89	-
存出保证金		8,478.48	1,357.15
交易性金融资产	6.4.7.2	40,172,897.16	210,814,472.24
其中：股票投资		7,556,826.26	33,988,334.54
基金投资		-	-
债券投资		32,616,070.90	176,826,137.70
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		-	-
应收证券清算款		19,206.65	-
应收利息	6.4.7.3	614,626.74	3,846,349.52
应收股利		-	-
应收申购款		10,304.00	1,698.81
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		41,020,169.44	215,641,904.17

负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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		100,000.00	43,249,735.12
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		60,916.38	101,931.19
应付管理人报酬		23,909.63	102,706.30
应付托管费		6,831.33	29,344.67
应付销售服务费		4,572.52	16,415.45
应付交易费用	6.4.7.4	29,006.40	10,453.29
应交税费		3,303.46	18,016.96
应付利息		-	31,020.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	107,194.37	460,063.12
负债合计		335,734.09	44,019,686.22
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.6	35,819,264.71	152,640,649.73
未分配利润	6.4.7.7	4,865,170.64	18,981,568.22
所有者权益合计		40,684,435.35	171,622,217.95
负债和所有者权益总计		41,020,169.44	215,641,904.17

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.1407 元，基金份额 24,188,027.07 份，C 类基金份额净值 1.1256 元，基金份额 11,631,237.64 份。

6.2 利润表

会计主体：新华增强债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
一、收入		-3,389,429.15	-1,467,986.31
1.利息收入		563,185.99	6,334,697.26
其中：存款利息收入	6.4.7.8	6,756.04	17,438.45
债券利息收入		552,379.81	6,266,690.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,050.14	50,567.94
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-330,304.29	1,184,184.64
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-2,251,208.57	1,525,467.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	1,940,952.26	-900,261.91
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	6.4.7.11	-20,047.98	558,979.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	-3,642,384.93	-9,009,815.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	20,074.08	22,947.19
减：二、费用		537,406.86	1,900,989.63
1. 管理人报酬		192,985.71	828,692.99
2. 托管费		55,138.78	236,769.49
3. 销售服务费		39,960.34	117,517.95
4. 交易费用	6.4.7.14	62,838.34	83,814.76
5. 利息支出		53,335.25	355,578.92
其中：卖出回购金融资产支出		53,335.25	355,578.92
6.税金及附加		3,363.81	21,256.40
7. 其他费用	6.4.7.15	129,784.63	257,359.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,926,836.01	-3,368,975.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,926,836.01	-3,368,975.94

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华增强债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	152,640,649.73	18,981,568.22	171,622,217.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,926,836.01	-3,926,836.01
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）	-116,821,385.02	-10,189,561.57	-127,010,946.59
其中：1.基金申购款	19,523,488.30	2,510,494.61	22,033,982.91

2.基金赎回款	-136,344,873.32	-12,700,056.18	-149,044,929.50
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）	35,819,264.71	4,865,170.64	40,684,435.35
项目	上年度可比期间 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）	203,076,191.58	24,534,781.00	227,610,972.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,368,975.94	-3,368,975.94
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）	-41,279,970.78	-3,748,022.43	-45,027,993.21
其中：1.基金申购款	56,731,352.29	8,482,961.09	65,214,313.38
2.基金赎回款	-98,011,323.07	-12,230,983.52	-110,242,306.59
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）	161,796,220.80	17,417,782.63	179,214,003.43

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：刘全胜，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

新华增强债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2931 号文件“关于核准新华信用增强债券型证券投资基金募集的批复”批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2016 年 3 月 14 日至 4 月 8 日向社会公开募集,首次募集资金总额 932,294,126.11 元,其中募集资金产生利息 114,213.39 元,并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2016]01360021 号验资报告予以验证。2016 年 4 月 13 日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不固定,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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债、短期融资券、超短期融资券、同业存单等）、货币市场工具、权证、资产支持证券、债券回购和银行存款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相关规定）。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。基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；持有现金或到期日在 1 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；权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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 2019 年 8 月 23 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华增强债券型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

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最近一期年度报告一致，所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

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

本基金报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期末未发生差错更正。

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。

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。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	193,657.52
定期存款	-
其他存款	-
合计	193,657.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,758,985.16	7,556,826.26	797,841.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,099,446.57	5,078,970.90
	银行间市场	34,079,732.23	27,537,100.00
	合计	39,179,178.80	32,616,070.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	45,938,163.96	40,172,897.16	-5,765,266.80

6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日

应收活期存款利息	53.00
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	3.78
应收债券利息	614,569.96
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	614,626.74

注：应收结算备付金利息中包含结算保证金利息。

6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	26,671.86
银行间市场应付交易费用	2,334.54
合计	29,006.40

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15.10
其他应付款	-
预提费用	107,179.27
合计	107,194.37

6.4.7.6 实收基金

新华增强债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	109,713,513.35	109,713,513.35

本期申购	11,179,925.91	11,179,925.91
本期赎回（以“-”号填列）	-96,705,412.19	-96,705,412.19
本期末	24,188,027.07	24,188,027.07

新华增强债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	42,927,136.38	42,927,136.38
本期申购	8,343,562.39	8,343,562.39
本期赎回（以“-”号填列）	-39,639,461.13	-39,639,461.13
本期末	11,631,237.64	11,631,237.64

6.4.7.7 未分配利润

新华增强债券 A

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	17,524,726.31	-3,497,740.84	14,026,985.47
本期利润	-8,603.80	-3,080,228.83	-3,088,832.63
本期基金份额交易产生的变动数	-13,663,058.78	6,129,055.62	-7,534,003.16
其中：基金申购款	1,655,944.88	-294,250.92	1,361,693.96
基金赎回款	-15,319,003.66	6,423,306.54	-8,895,697.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,853,063.73	-448,914.05	3,404,149.68

新华增强债券 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	6,307,289.01	-1,352,706.26	4,954,582.75
本期利润	-275,847.28	-562,156.10	-838,003.38
本期基金份额交易产生的变动数	-4,356,708.18	1,701,149.77	-2,655,558.41
其中：基金申购款	1,151,990.26	-3,189.61	1,148,800.65
基金赎回款	-5,508,698.44	1,704,339.38	-3,804,359.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,674,733.55	-213,712.59	1,461,020.96

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	6,363.87
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	392.17
其他	-
合计	6,756.04

注：应收结算备付金利息中包含结算保证金利息。

6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	30,719,331.97
减：卖出股票成本总额	32,970,540.54
买卖股票差价收入	-2,251,208.57

6.4.7.10 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	171,353,673.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	165,272,917.67
减：应收利息总额	4,139,803.66
买卖债券差价收入	1,940,952.26

6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	-20,047.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	-20,047.98

6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	-3,642,384.93
——股票投资	4,898,794.26
——债券投资	-8,541,179.19
——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	-3,642,384.93

6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	20,074.08
合计	20,074.08

6.4.7.14 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	59,508.34
银行间市场交易费用	3,330.00
合计	62,838.34

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	67,507.69

债券账户维护费	18,000.00
汇划手续费	4,005.36
其他	600.00
合计	129,784.63

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 2019 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
恒泰证券股份有限 公司	299,184.00	0.92%	2,000,964.00	3.75%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均未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期间，均未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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	-	-	9,700,000.00	5.41%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	218.80	0.84%	218.80	0.82%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	1,463.29	3.33%	-	-

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	192,985.71	828,692.99
其中：支付销售机构的客户维护费	61,269.44	115,474.11

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%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×0.70%/当年天数

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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	55,138.78	236,769.49

注：基金托管人报酬按前一日基金资产净值 0.20%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		
	2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华增强债券 A	新华增强债券 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	16,004.85	16,004.85
恒泰证券股份有限公司	-	451.00	451.00
新华基金管理股份有限公司	-	8,483.27	8,483.27
合计	-	24,939.12	24,939.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	新华增强债券 A	新华增强债券 C	合计
新华基金管理股份有限公司	-	60,571.39	60,571.39
恒泰证券股份有限公司	-	735.23	735.23
中国工商银行股份有限公司	-	27,772.36	27,772.36

合计	-	89,078.98	89,078.98
----	---	-----------	-----------

注：本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.4%/当年天数。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	新华增强债券A	新华增强债券C	新华增强债券A	新华增强债券C
期初持有的基金份额	0.00	-	-	-
期间申购/买入总份额	8,968,517.36	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	8,968,517.36	-	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	25.04%	-	-	-

6.4.10.3.2 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

报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.4 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	193,657.52	6,363.87	18,720,673.61	15,570.11

6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

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（2019 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

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董事会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发行的证券，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 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
A-1	-	59,940,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	9,199,700.00	55,322,500.00
合计	9,199,700.00	115,262,500.00

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 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
AAA	4,860,604.90	33,489,013.20
AAA 以下	14,274,194.00	12,593,124.50
未评级	4,281,572.00	15,481,500.00
合计	23,416,370.90	61,563,637.70

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 2019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	193,657.52	-	-	-	193,657.52
结算备付金	998.89	-	-	-	998.89
存出保证金	8,478.48	-	-	-	8,478.48
交易性金融资产	19,487,572.00	12,998,844.00	129,654.90	7,556,826.26	40,172,897.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	19,206.65	19,206.65
应收利息	-	-	-	614,626.74	614,626.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	10,304.00	10,304.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	19,690,706.89	12,998,844.00	129,654.90	8,200,963.65	41,020,169.44
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	100,000.00	-	-	-	100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	60,916.38	60,916.38
应付管理人报酬	-	-	-	23,909.63	23,909.63
应付托管费	-	-	-	6,831.33	6,831.33
应付销售服务费	-	-	-	4,572.52	4,572.52
应付交易费用	-	-	-	29,006.40	29,006.40
应交税费	-	-	-	3,303.46	3,303.46
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	107,194.37	107,194.37
负债总计	100,000.00	-	-	235,734.09	335,734.09
利率敏感度缺口	19,590,706.89	12,998,844.00	129,654.90	7,965,229.56	40,684,435.35
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	978,026.45	-	-	-	978,026.45
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	1,357.15	-	-	-	1,357.15
交易性金融资产	105,248,500.00	56,096,137.70	15,481,500.00	33,988,334.54	210,814,472.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,846,349.52	3,846,349.52
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,698.81	1,698.81
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	106,227,883.60	56,096,137.70	15,481,500.00	37,836,382.87	215,641,904.17
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	43,249,735.12	-	-	-	43,249,735.12
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	101,931.19	101,931.19
应付管理人报酬	-	-	-	102,706.30	102,706.30
应付托管费	-	-	-	29,344.67	29,344.67
应付销售服务费	-	-	-	16,415.45	16,415.45
应付交易费用	-	-	-	10,453.29	10,453.29
应交税费	-	-	-	18,016.96	18,016.96
应付利息	-	-	-	31,020.12	31,020.12
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	460,063.12	460,063.12
负债总计	43,249,735.12	-	-	769,951.10	44,019,686.22
利率敏感度缺口	62,978,148.48	56,096,137.70	15,481,500.00	37,066,431.77	171,622,217.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.2.2 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
		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	减少约 9	减少约 79
	市场利率下降 25.00 bp	增加约 9	增加约 80

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

本基金的资产与负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	7,556,826.26	18.57	33,988,334.54	19.80
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	32,616,070.9 0	80.17	176,826,137.7 0	103.03
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	40,172,897.1 6	98.74	210,814,472.2 4	122.84

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%	
	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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	沪深 300 指数上升 1%	-		增加约 32
	沪深 300 指数下降 1%	-		减少约 32

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	7,556,826.26	18.42
	其中：股票	7,556,826.26	18.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,616,070.90	79.51
	其中：债券	32,616,070.90	79.51
	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	194,656.41	0.47
8	其他各项资产	652,615.87	1.59
9	合计	41,020,169.44	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	1,055,208.00	2.59
C	制造业	2,477,640.00	6.09
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	-	-
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	2,864,028.26	7.04
K	房地产业	1,159,950.00	2.85
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	7,556,826.26	18.57

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	000001	平安银行	136,517	1,881,204.26	4.62
2	002475	立讯精密	69,600	1,725,384.00	4.24
3	001979	招商蛇口	55,500	1,159,950.00	2.85
4	601225	陕西煤业	114,200	1,055,208.00	2.59
5	601939	建设银行	132,100	982,824.00	2.42
6	300207	欣旺达	65,300	752,256.00	1.85

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	1,640,238.00	0.96

注：本项“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

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	601169	北京银行	3,825,348.00	2.23
2	601939	建设银行	3,514,894.00	2.05
3	601006	大秦铁路	2,983,230.31	1.74
4	600308	华泰股份	2,733,597.30	1.59
5	000001	平安银行	2,492,232.00	1.45
6	000581	威孚高科	2,331,448.68	1.36
7	601898	中煤能源	2,323,582.28	1.35
8	600048	保利地产	2,099,854.00	1.22
9	601225	陕西煤业	1,875,355.00	1.09
10	300207	欣旺达	1,872,956.00	1.09
11	001979	招商蛇口	1,772,320.00	1.03
12	601933	永辉超市	1,573,165.40	0.92
13	600030	中信证券	1,321,349.00	0.77

注：本项“卖出金额”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	1,640,238.00
卖出股票的收入（成交）总额	30,719,331.97

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，不考虑相关交易费用。

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	4,281,572.00	10.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,039,000.00	5.01

5	企业短期融资券	9,199,700.00	22.61
6	中期票据	16,298,400.00	40.06
7	可转债（可交换债）	797,398.90	1.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,616,070.90	80.17

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	011800757	18 康得新 SCP001	150,000	8,193,000.00	20.14
2	019611	19 国债 01	42,850	4,281,572.00	10.52
3	101800762	18 津保投 MTN008	40,000	4,083,600.00	10.04
4	101801124	18 抚州投资 MTN002	30,000	3,129,000.00	7.69
5	101801233	18 创元投资 MTN001	30,000	3,079,500.00	7.57

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

本基金合同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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 康得新复合材料集团股份有限公司（下称“公司”）于 2018 年 10 月 29 日及之后陆续发布《关于公司及控股股东、实际控制人收到中国证监会立案调查通知的公告》、《关于持股 5%以上股东收到中国证监会立案调查通知的公告》，截至报告期末，证券监管部门尚未就上述案件及大股东占用上市公司资金事项作出结论性意见或决定。本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金投资的其它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。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	8,478.48
2	应收证券清算款	19,206.65
3	应收股利	-
4	应收利息	614,626.74
5	应收申购款	10,304.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	652,615.87

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	光大转债	667,744.00	1.64

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

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
新华增强债券 A	474	51,029.59	8,968,517.36	37.08%	15,219,509.71	62.92%
新华增强债券 C	274	42,449.77	0.00	0.00%	11,631,237.64	100.00%
合计	748	47,886.72	8,968,517.36	25.04%	26,850,747.35	74.96%

8.2 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	新华增强债券 A	0.00	0.00%
	新华增强债券 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.3 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、基金投资和研发部门负责人	新华增强债券 A	0
	新华增强债券 C	0

持有本开放式基金	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华增强债券 A	0
	新华增强债券 C	0
	合计	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华增强债券 A	新华增强债券 C
基金合同生效日（2016 年 4 月 13 日）基金份额总额	405,907,897.38	526,500,442.12
本报告期期初基金份额总额	109,713,513.35	42,927,136.38
本报告期基金总申购份额	11,179,925.91	8,343,562.39
减：本报告期基金总赎回份额	96,705,412.19	39,639,461.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,188,027.07	11,631,237.64

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

2019 年 4 月 18 日，陈重先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司董事长。

2019 年 4 月 18 日，张宗友先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司总经理。

2019 年 4 月 18 日，张宗友先生新任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司董事长，代任总经理。

2019 年 6 月 6 日，刘全胜先生新任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司总经理。

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

本基金持有的“康得新复合材料集团股份有限公司 2018 年度第一期超短期融资券”（以下简称“18 康得新 SCP001”）到期日期为 2019 年 1 月 15 日，但截止到期日清算机构未收到发行人款项，故“18 康得新 SCP001”造成实质性违约。为尽快解决违约问题，最大限度保护投资者利益，本基金管理人

已于 2019 年 1 月 29 日向重庆市第一中级人民法院提起诉讼,要求被告支付“18 康得新 SCP001”本息及罚息,目前法院已受理该案,后续本基金管理人将持续推动案件的审理以期尽快执行。

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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	17,643,416.98	54.52%	12,982.09	50.13%	-
广发证券	3	10,813,439.99	33.42%	9,368.51	36.18%	-
招商证券	1	1,966,880.00	6.08%	1,831.75	7.07%	-
海通证券	1	1,135,319.00	3.51%	1,057.34	4.08%	-
国泰君安	1	360,552.00	1.11%	335.79	1.30%	-
恒泰证券	2	299,184.00	0.92%	218.80	0.84%	-
中信证券	3	140,778.00	0.44%	102.95	0.40%	-

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》（证监基金字[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 31 个交易席位，其中报告期内新增 0 个交易席位，退租 0 个交易席位。

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纪商的排名。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	4,400,000.00	10.48%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	579,344.00	4.58%	5,500,000.00	13.10%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	2,900,798.92	22.92%	100,000.00	0.24%	-	-
广发证券	7,403,795.00	58.50%	9,800,000.00	23.33%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	973,638.30	7.69%	7,000,000.00	16.67%	-	-
国泰君安	-	-	6,900,000.00	16.43%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	798,200.00	6.31%	8,300,000.00	19.76%	-	-

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	新华增强债券型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券时报、公司网站	2019-01-22
2	新华基金管理股份有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2019-01-26
3	新华基金管理股份有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2019-01-29
4	新华增强债券型证券投资基金招募说明书(更新)	公司网站	2019-01-31

5	新华增强债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	证券时报、公司网站	2019-01-31
6	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的信威集团估值方法调整的公告	证券日报、公司网站	2019-02-14
7	新华增强债券型证券投资基金 2018 年年度报告(摘要)	证券时报、公司网站	2019-03-28
8	新华增强债券型证券投资基金 2018 年年度报告	公司网站	2019-03-28
9	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2019-03-29
10	新华增强债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2019-04-18
11	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	证券时报、公司网站	2019-04-20
12	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京植信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	2019-05-08
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	证券时报、公司网站	2019-06-11
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2019-06-24
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2019 年半年度最后一日交易日资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2019-06-29

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	20190101-20190115	90,952,845.04	-	90,952,845.04	0.00	0.00%
	2	20190116-20190120	26,100,651.75	-	26,100,651.75	0.00	0.00%
	3	20190214-20190630	-	8,968,517.36	-	8,968,517.36	25.04%
产品特有风险							

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；

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；

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；

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

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信用增强债券型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华信用增强债券型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华增强债券型证券投资基金托管协议
- (四) 新华增强债券型证券投资基金基金合同
- (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《新华增强债券型证券投资基金招募说明书》
- (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

二〇一九年八月二十四日