

# 新华增强债券型证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

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

## 重要提示

新华增强债券型证券投资基金由新华信用增强债券型证券投资基金经 2017 年 8 月 9 日证监许可 [2017] 1468 号文准予变更注册而来。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会变更注册,但中国证监会对新华信用增强债券型证券投资基金的变更注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,自主判断基金的投资价值,对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险,包括利率风险,信用风险,流动性风险,再投资风险,通货膨胀风险,操作或技术风险,合规性风险,本基金特有的风险和其他风险。

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。

本基金投资于中小企业私募债券,面临信用风险及流动性风险。信用风险主要是由目前国内中小企业的发展状况所导致的发行人违约、不按时偿付本金或利息的风险;流动性风险主要是由债券非公开发行和转让所导致的无法按照合理的价格及时变现的风险。由于中小企业私募债券的特殊性,本基金的总体风险将有所提高。

投资有风险,投资者申购基金份额时应认真阅读招募说明书、基金合同及基金产品资料概要等信息披露文件。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不向投资者保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。

本摘要根据基金的基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本招募说明书(更新)所载其他内容截止日为2020年5月29日,有关财务数据和净值表现截止日为2020年3月31日(财务数据未经会计师事务所审计)。

本招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,将不晚于2020年9月1日起执行。

## 一 基金管理人

### (一) 基金管理人概况

名称:新华基金管理股份有限公司

住所:重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层

设立日期:2004年12月9日

法定代表人:张宗友

办公地址:重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号办公楼第19层

北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座

电话:010-68779666

传真:010-68779528

联系人:齐岩

注册资本:贰亿壹仟柒佰伍拾万元人民币

股权结构:

股东名称	出资额（万元人民币）	出资比例
恒泰证券股份有限公司	12,750	58.62%
新华信托股份有限公司	7,680	35.31%
杭州永原网络科技有限公司	1,320	6.07%
合计	21,750	100%

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

张宗友先生：董事长，硕士。历任内蒙古证券有限责任公司营业部总经理、太平洋证券股份有限公司副总经理、恒泰证券股份有限公司副总经理、新华基金管理股份有限公司总经理。现任新华基金管理股份有限公司董事长。

刘全胜先生，硕士，董事。历任内蒙古证券包头九原区证券服务部经理、内蒙古证券包头昆区证券服务部经理、恒泰证券区内经纪事业部总经理助理、恒泰证券包头钢铁大街营业部总经理助理、恒泰证券临河胜利北路营业部总经理、恒泰证券经纪业务管理总部总经理、恒泰证券总裁助理兼经纪事业部总经理、恒泰证券副总裁。现任新华基金管理股份有限公司总经理。

项琥先生，硕士，董事。历任中国国际信托投资公司天津分公司、中信证券天津证券业务部经理、天津协通咨询中心国债服务部副经理、天津未来保险代理有限公司总经理、新华信托股份有限公司天津业务部总经理、新华信托股份有限公司副总经理。现任新华信托股份有限公司董事总经理。

翟晨曦女士，经济学博士后，董事。曾任国家开发银行投资业务局、评审三局项目经理、国家开发银行资金交易部交易员、副处长、处长。现任天风证券股份有限公司副总裁、公司执行委员会副主任、天风国际董事局主席、恒泰证券联席总裁。

胡波先生：独立董事，博士。历任中国人民大学财政金融学院教师、中国人民大学风险投资发展研究中心研究员、副主任、执行主任。现任中国人民大学财政金融学院副教授。

胡湘先生，经济学硕士，独立董事。曾任全国社保基金理事会副处长、鹏华基金管理有限公司副总裁。现任浙江大钧资产管理有限公司总裁。

刘成伟先生，法学硕士，独立董事。曾任环球律师事务所律师、美国众达律师事务所（北京）顾问。现任环球律师事务所合伙人。

## 2、监事会成员

杨淑飞女士：监事会主席，硕士。历任航天科工财务公司结算部经理、航天科工财务公司风险管理部经理，航天科工财务公司总会计师、总法律顾问、董秘、副总裁，华浩信联（北京）科贸有限公司财务总监。现任恒泰证券股份有限公司财务总监。

张浩先生：职工监事，硕士。历任长盛基金管理有限公司信息技术部副总监，长盛基金管理有限公司风险管理部副总监，合众资产管理股份有限公司风险管理部总监，房宝信业（北京）投资管理有限公司总经理。现任新华基金管理股份有限公司监察稽核部总监。

别冶女士：职工监事，金融学学士。十年证券从业经验，历任《每日经济新闻》、《第一财经日报》财经记者，新华基金管理股份有限公司媒体经理。现任新华基金管理股份有限公司总经理办公室副主任。

## 3、高级管理人员

张宗友先生：董事长，简历同上。

刘全胜先生：总经理，简历同上。

齐岩先生：督察长，学士。历任中信证券股份有限公司解放北路营业部职员、天津管理部职员、天津大港营业部综合部经理。现任新华基金管理股份有限公司督察长兼任子公司北京新华富时资产管理有限公司董事。

徐端骞先生：副总经理兼任首席信息官，学士。历任上海君创财经顾问有限公司并购部经理、上海力矩产业投资管理有限公司并购部经理、新时代证券有限责任公司投行部项目经理、新华基金管理股份有限公司总经理助理兼运作保障部总监。现任新华基金管理股份有限公司副总经理兼任首席信息官。

## 4、基金经理

### （1）历任基金经理

于泽雨先生：管理本基金时间：2016年4月13日—2018年2月6日

### （2）现任基金经理

李显君先生，工商管理及金融学硕士，12年证券从业经验，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。2016年4月加入新华基金管理股份有限公司，现任新华增强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。

王滨先生，管理学硕士，13年证券从业经验。历任中国工商银行总行固定收益投资经理、中国民生银行投资经理、民生加银基金管理有限公司基金经理。2016年6月加入新华基金管理股份有限公司，现任固定收益与平衡投资部总监、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理、新华鑫日享中短债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、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华安享惠泽39个月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。。

李洁女士：经济学硕士，5年证券从业经验。历任中债信用业务经理、高级经理。2015年9月加入新华基金管理股份有限公司，先后担任债券研究员、基金经理助理，现任新华活期添利货币市场基金基金经理、新华增强债券型证券投资基金基金经理、新华安享惠泽39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

#### 5、投资管理委员会成员

投资管理委员会成员主席：总经理刘全胜先生；成员：投资副总监于泽雨先生、投资副总监姚秋先生、权益投资部总监赵强先生、固定收益与平衡投资部总监王滨先生、研究部总监张霖女士、基金经理付伟先生、基金经理栾超先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二 基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

## （二）主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

## （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，中国工商银行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 68 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培

育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十二次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。



(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。资产托管部通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重之一，保持与业务发展同等地位。

资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### (五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基

金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查,其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

## 三 相关服务机构

### (一) 基金份额销售机构

基金份额销售机构包括基金管理人的直销机构和其他销售机构的销售网点:

#### 1、直销机构

##### (1) 新华基金管理股份有限公司直销中心

办公地址:北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座

住所:重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼第 19 层

法定代表人:张宗友

电话:010-68730999

联系人:陈静

公司网址:www.ncfund.com.cn

客服电话:400-819-8866

##### (2) 电子直销:新华基金网上交易平台

网址:https://trade.ncfund.com.cn

#### 2、其他销售机构

##### (1) 中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：郭明

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

联系人：张静

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

(3) 交通银行股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

联系人：曹榕

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(4) 平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

客服电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

(5) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

联系人：杨文川

客服电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

(6) 中国民生银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街 2 号

联系人:穆婷

法定代表人:洪崎

客服电话: 95568

网址: [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(7) 恒泰证券股份有限公司

住所: 内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人: 庞介民

联系人: 熊丽

客服电话: 400-196-6188 , 956088

网址: [www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

(8) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址: 北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团  
总部 A 座 15 层

法定代表人: 王苏宁

客服电话: 个人业务: 95118 企业业务: 400-088-8816

网址: <http://fund.jd.com>

(9) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

法定代表人: 何静

联系人: 王重阳

座机: 010-65951887

客服电话: 400-618-0707

公司网址: [www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

(10) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址: 北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座综合楼 712 号

法定代表人：梁蓉

联系人：李婷婷

客服电话：400-6262-818

公司网站：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(11) 浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

法定代表人：聂婉君

客服电话：400-012-5899

联系人：李艳

公司网站：[www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

(12) 天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层  
202-124 室

法定代表人：丁东华

联系人：郭宝亮

客服电话：400-111-0889

公司网站：[www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

(13) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：胡凯隽

客服电话：400-700-9665

公司网址：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

(14) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

联系人：刘洋

公司网站：licaike.hexun.com

(15) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：周斌

联系人：张晔

客服电话：4007-868-868

公司网站：www.chtfund.com

(16) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(17) 上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：金佶

汇付网站：www.wincaifu.com

客服电话：400-821-3999

(18) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

住所：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼冠捷大厦 3 层 307 单元

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

客服电话： 400-673-7010

公司网站： [www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

(19) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人： 陈继武

联系人：葛佳蕊

客服电话：4000-178-000

网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

(20) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：曹怡晨

客服电话：400-067-6266

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

(21) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

客服电话： 400-118-1188

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(22) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：胡学勤

联系人：何雪

客服电话：400-821-9031



公司网站: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(23) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 楼

法定代表人: 陈柏青

客服电话: 400-766-123

联系人: 韩爱彬

网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(24) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人: 刘汉青

联系人: 王锋

客服电话: 95177

公司网站: [www.snjjjin.com](http://www.snjjjin.com)

(25) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村东路 18 号 1 号楼 11 层 B-1108

办公地址: 北京市海淀区中关村东路 18 号 1 号楼 11 层 B-1108

法定代表人: 王利刚

客服电话: 400-875-9885

联系人: 盛海娟

公司网站: [www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(26) 上海长量基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

联系人: 唐诗洋

客服电话: 400-820-2899

公司网站: [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(27) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公里 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002-A1003 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

客服电话：400-820-5369

公司网站：www.jiyufund.com.cn

(28) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

联系人：童彩平

公司网址：www.zlfund.cn, www.jjmmw.com

(29) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：李春光

联系人：李晓涵

客服电话：400-0411-001

公司网址：www.haojiyoujijin.com/www.taichengcaifu.com

(30) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

联系人：丁珊珊

公司网址：www.1234567.com.cn

(31) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：林海明

客服电话：4008-773-772

公司网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(32) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

法定代表人：陈洪生

联系人：袁艳艳

客服电话：400-918-0808

公司网站：[www.dkhs.com](http://www.dkhs.com)

(33) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 国际企业大厦 C 座 9 层

法定代表人：马勇

联系人：张燕

客服电话：400-166-1188

网址：<http://www.new-rand.cn>

(34) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2  
地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 8 号楼新浪总部大厦

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

客服电话：010-62675369

公司网站：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

(35) 一路财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区宝盛南路1号院20号楼9层101-14

办公地址：北京市海淀区奥北科技园—国泰大厦9层

法定代表人：吴雪秀

联系人：刘栋栋

客服电话：400-001-1566

网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(36) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座180

法定代表人：戎兵

联系人：刘梦轩

客服电话：400-6099-200

公司网站：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(37) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼  
B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：钟琛

客服电话：020-89629066

公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(38) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-8188-000

联系人：马林

公司网站：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(39) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：仲甜甜

客服电话：4008-909-998

网址：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

(40) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

客服电话：400-684-0500

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(41) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(42) 万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人：张军

客服电话：010-59013842

网址：[www.wanjiawealth.com](http://www.wanjiawealth.com)

(43) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 楼

办公地址：大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 楼

法定代表人：樊怀东

联系人：辛志辉

客服电话：4000899100

公司网址：<http://www.yibaijin.com>

(44) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 1 号 1 号楼昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

联系人：王磊

客服电话：95510

网址：<http://fund.sinosig.com/>

(45) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑 10 号楼

法定代表人：于龙

联系人：张喆

客服电话：4006-802-123

网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(46) 重庆农村商业银行股份有限公司

注册地址：重庆市江北区金沙门路 36 号

办公地址：重庆市江北区金沙门路 36 号

法定代表人：刘建忠

联系人：范亮

客服电话：966866

网址：[www.cqrcb.com](http://www.cqrcb.com)

(47) 大泰金石基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆  
2105 室

法定代表人：袁顾明

客服电话：400-928-2266

公司网址：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

(48) 民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

联系人：林志枫

电话：15626219801

电子邮件：[linzhifeng@msfgroup.com](mailto:linzhifeng@msfgroup.com)

(49) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

联系人：刘洋

公司网站：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(50) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

法定代表人：钟雯雯

联系人：王悦

座机：010-61840688

客服电话：400-159-9288

网址：[danjuanapp.com](http://danjuanapp.com)

(51) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：罗细安

联系人：张蕾

客服电话：010-67000988

公司网站：www.zcvc.com.cn

(52) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

联系人：林伊灵

客服电话：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## (二) 登记机构

名称：新华基金管理股份有限公司

住所：重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼第 19 层

办公地址：北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座

重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼第 19 层

法定代表人：张宗友

电话：023-63711923

传真：023-63710297

联系人：陈猷忱

## (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：(021) 31358666



传真：(021) 31358600

经办律师：安冬、陆奇

联系人：陆奇

#### (四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

办公地址：北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔  
11 层

法定代表人：刘贵彬

电话：010—88219191

传真：010—88210558

注册会计师：吕金保、姜明明

经办人：姜明明

## 四 基金的名称

本基金名称：新华增强债券型证券投资基金。

## 五 基金的类型

基金类型：契约型开放式。

## 六 基金的投资目标

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。

## 七 基金的投资方向

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。

## 八 基金的投资策略

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。

### 1、大类资产配置策略

本基金的大类资产配置策略遵循“自上而下”的基本原则,在对宏观经济和证券市场走势进行科学研判的基础上,具体确定各大类资产的配置比例。在客观分

析宏观经济和证券市场因素的基础上,基金管理人将对各类资产的预期收益水平进行科学预判,并据此具体设定基金资产在债券类资产和其他资产上的配置比例,同时设定债券组合在组合目标久期、信用配置、券种配置等方面的基本原则和策略,并根据市场情况的变化及时进行相应的调整。

## 2、固定收益类资产投资策略

### (1) 平均久期配置

本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析,预测未来的利率趋势,判断债券市场对上述变量和政策的反应,并据此对债券组合的平均久期进行调整,提高债券组合的总投资收益。

### (2) 期限结构配置

本基金对债券市场收益率期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,预测收益率期限结构的变化方式,选择确定期限结构配置策略,配置各期限固定收益品种的比例,以达到预期投资收益最大化的目的。

### (3) 类属配置

本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

### (4) 信用债券投资策略

#### 1) “自下而上”精选个券

本基金通过对债券发行人所处行业、公司治理结构、财务状况、信息披露等情况进行评估,并在此基础上,考虑个券流动性、信用等级、票息率等因素,自下而上的精选个券。

#### 2) 信用利差策略

随着债券市场的发展,各种级别的信用产品(主要是政府信用债券与企业主体债券、各类企业主体债券之间)会形成一个不同收益率水平的利差结构体系。在正常条件下,由信用风险形成的收益率利差是稳定的,但在特定条件下,比如某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时,这种稳定关系将被打破。本基金将利用定性与定量相结合的方式,对整个市场的信

用利差结构进行全面分析，在有效控制整个组合信用风险的基础上，采取积极的投资策略，发现价值被低估的信用类债券产品，挖掘投资机会，获取超额收益。

### 3) 骑乘策略

基金管理人将通过分析收益率曲线各期限段的期限利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着持有债券时间的延长，该债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，届时卖出该债券可获得资本利得收入。该策略的关键是收益率曲线的陡峭程度，若收益率曲线较为陡峭，则随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会有较大下滑，进而获得较高的资本利得。

### (5) 息差放大策略

该策略是利用债券回购收益率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。该策略的基本模式即是利用买入债券进行正回购，再利用回购融入资金购买收益率较高债券品种。在执行息差放大策略时，基金管理人将密切关注债券收益率与回购收益率的相互关系，并始终保持回购利率低于债券收益率。

### (6) 可转换债券投资策略

可转换债券是一种兼具债券和股票特性的复合性衍生证券，本基金对可转换债券的投资主要从公司基本面分析、理论定价分析、投资导向的变化等方面综合考虑。本基金在不同的市场环境中，对可转换债券投资的投资导向也有所不同。一般而言，在熊市环境中，更多地关注可转换债券的债性价值、上市公司的信用风险以及条款博弈的价值；在牛市环境中，则更多地关注可转换债券的股性价值。

### (7) 中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。

本基金将根据对宏观经济的研究，前瞻性判断经济周期，调整组合汇总中小企业私募债的配置比例。同时，根据债券市场的收益率水平，重点考虑个券的风险收益水平，综合考虑个券的信用等级（如有）、期限、流动性、息票率、提前偿还和赎回等因素，结合债券发行人所处行业发展前景、发行人业务发展状况、企业市场地位、财务状况、管理水平及其债务水平等，以确定债券的实际信用风险状况及其信用利差水平，重点选择信用风险相对较低、信用利差收益相对较大、或预期信用质量将改善的中小企业私募债。

基金在控制信用风险的基础上,对中小企业私募债投资,主要采取分散投资,控制个债持有比例。当预期发债企业的基本面情况出现恶化时,采取“尽早出售”策略,控制投资风险。

#### (8) 资产支持证券的投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响。在严格控制风险的情况下,结合信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

### 3、权益类资产投资策略

#### (1) 股票投资策略

本基金主要采取自下而上的个股精选策略。一方面,本基金将从公司盈利模式、盈利能力、所属行业发展前景、公司行业地位、竞争优势、治理结构等方面对公司进行深入分析和研究,筛选出具有持续成长性且估值相对合理的个股进行重点关注。另一方面,本基金也将积极跟踪公司股价表现,运用趋势跟踪及模式识别模型进行股价跟踪,重点关注股价具有向上趋势的个股。基于以上两方面构建股票投资组合,以提高基金的整体收益水平。

#### (2) 权证投资策略

在控制风险的前提下,本基金将采用以下策略。普通策略:根据权证定价模型,选择低估的权证进行投资。持股保护策略:利用认沽权证,可以实现对手中持股的保护。套利策略:当认沽权证和正股价的和低于行权价格时,并且总收益率超过市场无风险收益率时,可以进行无风险套利。

## 九 基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%。

中国债券综合全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围更加全面,具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),

能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的反映 A 股市场整体走势的指数。它的样本涵盖了沪深两个证券市场大部分流通市值，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

基于本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 十 基金的风险收益特征

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。

## 十一 基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定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。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 3 月 31 日。

### 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	4,846,545.60	15.70

	其中：股票	4,846,545.60	15.70
2	固定收益投资	25,115,071.98	81.38
	其中：债券	25,115,071.98	81.38
	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	420,215.94	1.36
7	其他各项资产	480,615.04	1.56
8	合计	30,862,448.56	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,935,062.80	9.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	697,930.00	2.34
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	1,213,552.80	4.07
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	4,846,545.60	16.25

## 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	28,080	1,071,532.80	3.59
2	600031	三一重工	41,200	712,760.00	2.39
3	601186	中国铁建	71,000	697,930.00	2.34
4	000895	双汇发展	17,300	679,890.00	2.28
5	600036	招商银行	16,600	535,848.00	1.80
6	600690	海尔智家	32,700	470,880.00	1.58
7	000001	平安银行	29,066	372,044.80	1.25
8	601658	邮储银行	58,000	305,660.00	1.03

## 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	3,384,192.50	11.35
	其中：政策性金融债	3,384,192.50	11.35
4	企业债券	5,276,270.00	17.69
5	企业短期融资券	10,205,600.00	34.23
6	中期票据	4,162,000.00	13.96
7	可转债（可交换债）	2,087,009.48	7.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-



10	合计	25,115,071.98	84.22
----	----	---------------	-------

## 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	011800757	18 康得新 SCP001	150,000	8,193,000.00	27.48
2	018007	国开 1801	33,590	3,384,192.50	11.35
3	124410	13 国网 03	29,000	2,955,100.00	9.91
4	101801124	18 抚州投资 MTN002	20,000	2,101,600.00	7.05
5	011901564	19 潍坊滨投 SCP001	20,000	2,012,600.00	6.75

## 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。

## 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。

## 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。

## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## (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。

## (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。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## (1) 本期国债期货投资政策

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

## (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。

## 11、投资组合报告附注

(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。

“邮储银行”发行人中国邮政储蓄银行股份有限公司因可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、未传递或缺失可回溯视频资料、质检不合格业务占比较高行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》，银保监会处以罚款合计 50 万元。（银保监罚决字〔2020〕2 号，2020 年 3 月 18 日）

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。

(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。

### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,349.36
2	应收证券清算款	99,953.09
3	应收股利	-
4	应收利息	305,653.29
5	应收申购款	70,659.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	480,615.04

### (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	113011	光大转债	1,304,494.00	4.37
2	110051	中天转债	9,397.60	0.03

3	113021	中信转债	7,595.00	0.03
---	--------	------	----------	------

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

(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。

## 十二 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金成立以来的业绩如下：

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

(1) 新华增强债券 A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016.4.13-2016.12.31	5.00%	0.13%	-4.12%	0.15%	9.12%	-0.02%
2017.1.1-2017.12.31	6.88%	0.15%	-5.48%	0.10%	12.36%	0.05%
2018.1.1-2018.12.31	0.51%	0.30%	1.51%	0.14%	-1.00%	0.16%
2019.1.1-2019.12.31	7.70%	0.37%	4.53%	0.12%	3.17%	0.25%
2020.1.1-2020.3.31	-1.96%	0.59%	0.70%	0.16%	-2.66%	0.43%
成立至今 (2016.4.13-2020.3.31)	19.09%	0.29%	-3.16%	0.13%	22.25%	0.16%

(2) 新华增强债券 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016.4.13-2016.12.31	4.80%	0.13%	-4.12%	0.15%	8.92%	-0.02%

. 12. 31						
2017. 1. 1-2017. 12. 31	6. 34%	0. 14%	-5. 48%	0. 10%	11. 82%	0. 04%
2018. 1. 1-2018. 12. 31	0. 09%	0. 30%	1. 51%	0. 14%	-1. 42%	0. 16%
2019. 1. 1-2019. 12. 31	7. 25%	0. 37%	4. 53%	0. 12%	2. 72%	0. 25%
2020. 1. 1-2020. 3. 31	-2. 06%	0. 59%	0. 70%	0. 16%	-2. 76%	0. 43%
成 立 至 今 ( 2016. 4. 13-20 20. 3. 31)	17. 17%	0. 29%	-3. 16%	0. 13%	20. 33%	0. 16%

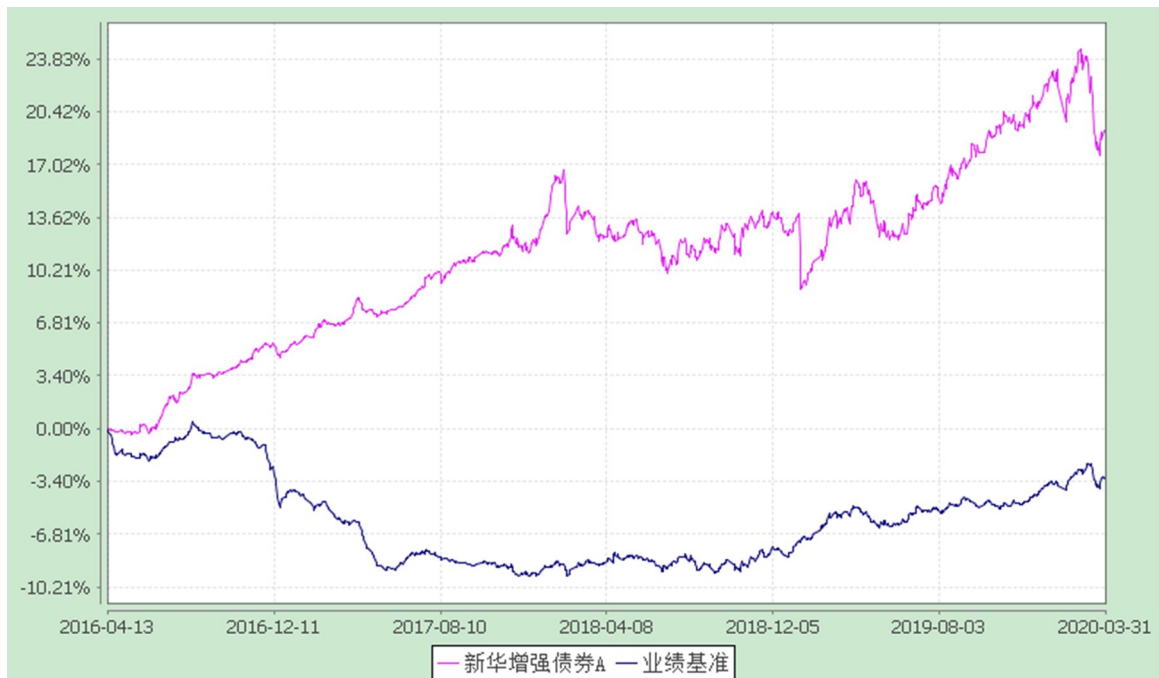
## 2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华增强债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的

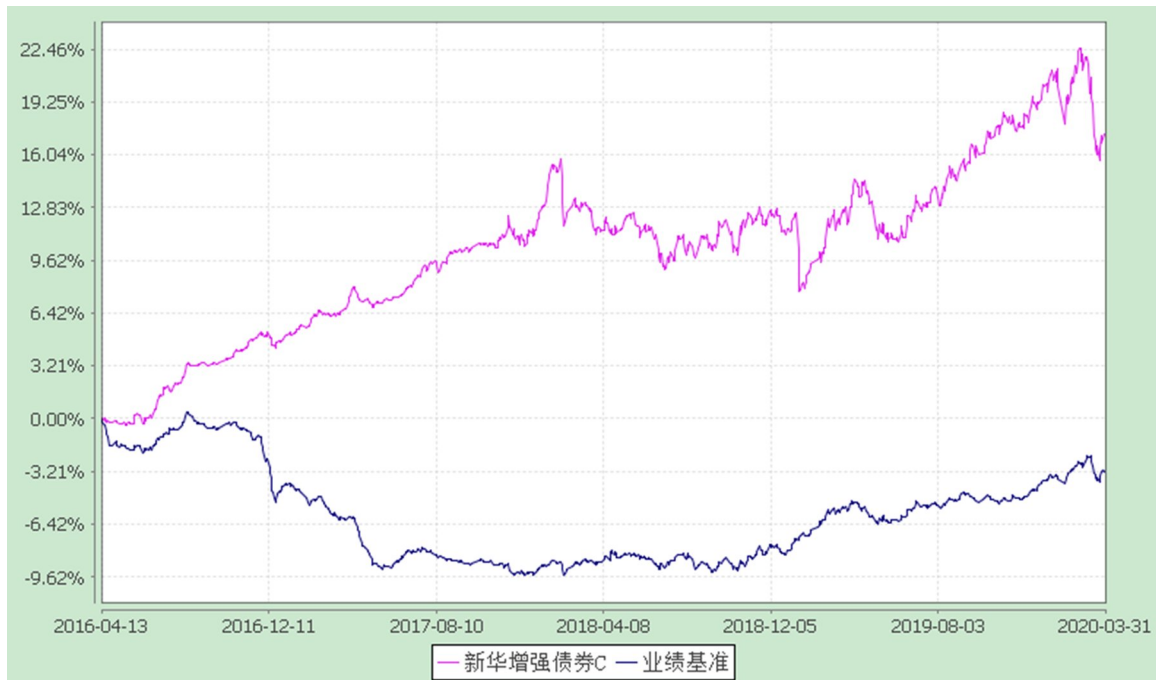
### 历史走势对比图

(2016年4月13日至2020年3月31日)

#### 1. 新华增强债券 A:



#### 2. 新华增强债券 C:



注：报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

## 十三 基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用、账户开户费用、账户维护费；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2020 年 5 月 14 日公布的《新华增强债券型证券投资基金招募说明书（更新）》进行了更新，主要更新的内容如下：

- （一）在“重要提示”中，更新了招募说明书内容的截止日期。
- （二）在“三、基金管理人”中，更新了基金管理人的相关信息。
- （三）在“四、基金托管人”中，更新了基金托管人的相关信息。
- （四）在“五、相关服务机构”中，更新了相关服务机构信息。
- （五）在“九、基金的投资”中，更新了本基金投资组合报告的内容，数据截止日为 2020 年 3 月 31 日。
- （六）更新了“十、基金的业绩”数据，数据截止日为 2020 年 3 月 31 日。

(七)在“二十二、其他应披露事项”中,披露了自2019年6月19日至2020年5月29日期间本基金的公告信息:

- 1、本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项
- 2、2019年6月24日 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
- 3、2019年6月29日 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
- 4、2019年7月4日 新华基金管理股份有限公司关于公司法定代表人变更的公告
- 5、2019年7月8日 新华基金管理股份有限公司关于取消浙江金观诚基金销售有限公司为销售机构的公告
- 6、2019年7月19日 新华增强债券型证券投资基金2019年第2季度报告
- 7、2019年8月1日 新华增强债券型证券投资基金招募说明书(更新)
- 8、2019年8月24日 新华增强债券型证券投资基金2019年半年度报告
- 9、2019年9月12日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、基金转换业务及参加费率优惠活动的公告
- 10、2019年9月20日 新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加中信建投证券股份有限公司为销售机构的公告
- 11、2019年9月25日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海好买基金销售有限公司调整定期定额投资业务起点金额的公告
- 12、2019年10月24日 新华增强债券型证券投资基金2019年第3季度报告
- 13、2019年10月26日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、基金转换业务及参加费率优惠活动的公告
- 14、2019年11月22日 新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司为销售机构的公告
- 15、2019年11月26日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在奕



丰基金销售有限公司调整基金最低申购金额、定期定额投资业务起点的公告

16、2019年12月13日 新华增强债券型证券投资基金招募说明书(更新)

17、2019年12月13日 新华增强债券型证券投资基金基金合同及托管协议(更新)

18、2019年12月27日 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基金费率优惠活动的公告

19、2020年1月2日 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

20、2020年1月10日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在蚂蚁(杭州)基金销售有限公司调整基金最低申购金额的公告

21、2020年1月20日 新华基金管理股份有限公司旗下全部基金2019年第4季度报告提示性公告

22、2020年1月20日 新华增强债券型证券投资基金2019年第4季度报告

23、2020年2月3日 新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加安信证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告

24、2020年2月24日 “新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁(杭州)基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、基金转换业务及参加网上费率优惠活动的公告”

25、2020年3月17日 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金增加上海好买基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告

26、2020年3月18日 新华基金管理股份有限公司新华增强债券型证券投资基金基金经理变更公告

27、2020年3月19日 新华增强债券型证券投资基金招募说明书(更新)

28、2020年3月20日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换业务及参加网上费率优惠活动的公告

29、2020年3月26日 新华基金管理股份有限公司旗下全部基金2019年年

度报告提示性公告

30、2020年3月26日 新华增强债券型证券投资基金2019年年度报告

31、2020年3月27日 新华基金管理股份有限公司关于董事及独立董事变更的公告

32、2020年4月8日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加恒泰证券股份有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告

33、2020年4月21日 新华增强债券型证券投资基金2020年第1季度报告

34、2020年4月21日 新华基金管理股份有限公司旗下全部基金2020年第1季度报告提示性公告

35、2020年4月30日 新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告

36、2020年4月30日 新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告

37、2020年5月13日 新华基金管理股份有限公司新华增强债券型证券投资基金基金经理变更公告

38、2020年5月14日 新华增强债券型证券投资基金招募说明书(更新)

39、2020年5月27日 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加民商基金销售(上海)有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告

新华基金管理股份有限公司

2020年7月10日