

# 新华丰利债券型证券投资基金

## 2022 年第 2 季度报告

2022 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：二〇二二年七月二十日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	新华丰利债券
基金主代码	003221
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 10 月 26 日
报告期末基金份额总额	43,704,897.08 份
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，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	新华丰利债券 A	新华丰利债券 C
下属分级基金的交易代码	003221	003222
报告期末下属分级基金的份额总额	9,542,808.68 份	34,162,088.40 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)	
	新华丰利债券 A	新华丰利债券 C
1.本期已实现收益	67,264.20	193,379.72
2.本期利润	548,450.77	1,877,803.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0575	0.0545
4.期末基金资产净值	12,278,917.15	42,985,856.95
5.期末基金份额净值	1.2867	1.2583

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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、新华丰利债券 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
过去三个月	4.68%	0.37%	0.93%	0.14%	3.75%	0.23%
过去六个月	2.51%	0.33%	-0.51%	0.15%	3.02%	0.18%
过去一年	2.84%	0.28%	0.28%	0.13%	2.56%	0.15%
过去三年	18.06%	0.31%	5.39%	0.13%	12.67%	0.18%
过去五年	25.72%	0.29%	9.73%	0.13%	15.99%	0.16%
自基金合同 生效起至今	28.67%	0.28%	6.01%	0.13%	22.66%	0.15%

##### 2、新华丰利债券 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
过去三个月	4.57%	0.37%	0.93%	0.14%	3.64%	0.23%
过去六个月	2.31%	0.33%	-0.51%	0.15%	2.82%	0.18%
过去一年	2.43%	0.28%	0.28%	0.13%	2.15%	0.15%
过去三年	16.71%	0.31%	5.39%	0.13%	11.32%	0.18%
过去五年	23.29%	0.29%	9.73%	0.13%	13.56%	0.16%
自基金合同 生效起至今	25.83%	0.28%	6.01%	0.13%	19.82%	0.15%

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

新华丰利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 10 月 26 日至 2022 年 6 月 30 日)

##### 1. 新华丰利债券 A：



注：本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。

## 2. 新华丰利债券 C:



注：本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。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马英	本基金基金经理，新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理。	2022-03-07	-	15	金融学硕士，历任第一创业证券有限责任公司固定收益部业务董事、第一创业摩根大通证券有限责任公司投资银行部副总经理、新华基金管理股份有限公司债券研究员、基金经理助理。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

## 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华丰利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》、《新华丰利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 公平交易专项说明

#### 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办法》，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。该办法规范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。

公司通过合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，使各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”作为交易执行的公平原则，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。

本报告期内，公平交易管理执行情况良好。

#### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾二季度，国内在 4-5 月份疫情冲击下 PMI 连续跌破 50，6 月疫情得到有效控制，复工复产，物流好转，供应链恢复，高频数据边际回暖，消费环比持续改善，整体呈现疫后复苏态势。第九版防控方案发布，防疫政策优化，疫情和防疫对经济的负面冲击将减弱，政策重心重回稳增长。

海外扰动压力最大的阶段或已经过去，通胀预期和加息的路径短期反应的较为充分，美债季末回落较快。国内流动性充裕，回购价格维持低位，仅跨季当日波动较大，整体保持平稳。

利率债整体先下后上，10 年期国债在 2.7%-2.85%区间震荡，季末较季初上行 5BP 左右至 2.82%。10 年期国开债上行 3BP 至 3.05%，1 年期国开债收益率下行 27BP 至 2.01%，曲线陡峭化。信用债方面，配置需求支撑下，中高等级信用债各期限均有所下行，信用利差进一步压缩。

上证综指二季度上涨 4.5%，行业涨多跌少，其中汽车、食品饮料、电力设备等涨幅较大。中证转债指数上涨 4.68%，股性估值有所抬升。

本基金纯债部分主要为中短久期信用债，为组合提供稳定的票息收入。股票持仓以价值为主，成长为辅，适度增加了稳增长方向标的，行业配置上较为均衡。转债底部增加了仓位。二季度净值波动向上，主要贡献来自于股票的修复和转债。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.2867 元，本报告期份额净值增长率为 4.68%，同期比较基准的增长率为 0.93%；本基金 C 类份额净值为 1.2583 元，本报告期份额净值增长率为 4.57%，同期比较基准的增长率为 0.93%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,274,699.70	13.22
	其中：股票	8,274,699.70	13.22
2	固定收益投资	45,851,030.41	73.27
	其中：债券	45,851,030.41	73.27
	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	8,303,912.76	13.27
7	其他各项资产	151,923.76	0.24
8	合计	62,581,566.63	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	4,612,025.70	8.35
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	3,212,645.00	5.81
K	房地产业	231,650.00	0.42
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	218,379.00	0.40
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	8,274,699.70	14.97

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600030	中信证券	34,300	742,938.00	1.34
2	601166	兴业银行	34,900	694,510.00	1.26
3	601318	中国平安	14,300	667,667.00	1.21
4	601658	邮储银行	92,800	500,192.00	0.91
5	002594	比亚迪	1,400	466,886.00	0.84
6	600690	海尔智家	14,800	406,408.00	0.74
7	300750	宁德时代	700	373,800.00	0.68
8	002508	老板电器	10,100	363,903.00	0.66
9	000568	泸州老窖	1,300	320,502.00	0.58
10	002572	索菲亚	11,400	313,500.00	0.57

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,663,794.91	4.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,805,925.26	8.70
5	企业短期融资券	10,178,798.19	18.42
6	中期票据	4,183,757.37	7.57
7	可转债（可交换债）	24,018,754.68	43.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,851,030.41	82.97

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	101901481	19 泉州台商 MTN001	40,000	4,183,757.37	7.57
2	1980376	19 港绿 01	40,000	4,165,365.92	7.54
3	012280085	22 宿迁新城 SCP001	40,000	4,069,322.52	7.36
4	012104043	21 驻马店投 SCP001	30,000	3,082,397.26	5.58
5	012280955	22 青岛水务 SCP001	30,000	3,027,078.41	5.48

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期本基金未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金合同尚无国债期货投资评价。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

#### 1、“中信证券”的发行人中信证券股份有限公司：

(1) 2021 年 11 月收到深交所因其为思创医惠可转债发行项目保荐人，因其履行保荐职责不到位，内部控制存在一定的薄弱环节，违反相关规定。鉴于上述违规事实及情节，依照《审核规则》第三十七条、第三十九条的规定，所以深交所决定对中信证券采取书面警示的监管措施。

(2) 2022 年 6 月收到证监会关于对其采取责令改正措施的决定：经查，证监会发现公司存在以下行为：一是 2015 年设立中信证券海外投资有限公司，未按照当时《证券法》第一百二十九条的规定报证监会批准。二是未按期完成境外子公司股权架构调整工作，存在控股平台下设控股平台、专业子公司下设专业子公司、特殊目的实体（SPV）下设子公司、股权架构层级多达 8 层等问题。三是存在境外子公司从事房地产基金管理非金融相关业务和返程子公司从事咨询、研究等业务的问题。

#### 2、“兴业银行”的发行人兴业银行股份有限公司：

(1) 因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送 14 项违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款 350 万元。（银保监罚决字〔2022〕22 号，2022 年 3 月 21 日）

(2) 因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，中国人民银行对其罚款 5 万元。（银罚字〔2021〕26 号，2021 年 8 月 20 日）

(3) 因未按规定履行客户身份识别义务，中国人民银行福州中心对其罚款 43 万元。（福银罚字〔2021〕29 号，2021 年 7 月 14 日）

(4) 因适当性管理落实不到位、向个人住房按揭贷款客户搭售人身意外险以及代销保险业务中欺骗投保人等行为被银保监会通报。（银保监会消费者权益保护局 2021 年第 12 号通报《关于兴业银行侵害消费者权益情况的通报》，2021 年 7 月 7 日）。

#### 3、“邮储银行”的发行人邮政储蓄银行：

(1) 因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在十三项违法违规行为，被银保监会罚款 370 万元。【银保监罚决字〔2022〕16 号】

(2) 邮储银行利用市场优势地位转嫁抵押评估费，因违规及不当收费问题被点名。

(3) 邮储银行在相关债务融资工具的簿记建档过程中，未按照《发行方案》及《申购说明》约定时间接受申购定单，开展相关簿记工作；其次，是成为非金融企业债务融资工具 A 类主承销商以来，未及时合规配备、使用簿记场所和设备，未能妥善保管簿记建档期间相关工作底稿。

(4) 银保监会因邮政储蓄银行违反相关审慎经营原则,如:向监管机构报送材料内容不实等,作出罚款 449 万的决定,【银保监罚决字(2021)23 号】

(5) 邮储银行因违反规定办理资本项目资金收付等被处以警告,被国家外汇管理局北京外汇管理部没收违法所得 673625.55 元,处 444 万元罚款。

(6) 邮储银行因违反账户管理相关规定,警告并处罚 600 万元。【银罚字(2021)16 号】

4、“老板电器”的发行人杭州老板电器股份有限公司于 2022 年 2 月 25 日被安徽省消保委公开约谈:主要有安装存在重大安全隐患、辅材使用五花八门、收费乱象丛生、安装工艺及专业水平参差不齐、承诺与实际不符五大问题;并对存在的问题进行整改。

5、“22 青岛水务 SCP001”的发行人青岛水务集团有限公司于 2021 年 7 月 31 日,被自然资源部公开通报 2021 年第二季度青岛水务集团有限公司涉嫌违法用海用岛情况,违法用海用岛均已移交有关执法机关依法进行查处,并被处罚 4675 万元。

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他前十名证券的发行主体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。

5.11.2 本报告期,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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,958.69
2	应收证券清算款	149,632.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	332.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	151,923.76

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113042	上银转债	2,217,088.57	4.01
2	113052	兴业转债	1,644,921.70	2.98
3	110053	苏银转债	1,604,978.57	2.90
4	110059	浦发转债	1,379,043.96	2.50
5	113013	国君转债	1,338,164.75	2.42
6	110081	闻泰转债	1,167,785.10	2.11
7	113050	南银转债	1,084,526.80	1.96
8	113623	凤 21 转债	560,990.85	1.02
9	128134	鸿路转债	553,234.56	1.00
10	113602	景 20 转债	540,954.87	0.98
11	113044	大秦转债	536,565.76	0.97
12	128136	立讯转债	533,081.66	0.96
13	113045	环旭转债	528,162.50	0.96
14	123025	精测转债	515,453.71	0.93
15	127031	洋丰转债	466,560.37	0.84
16	113616	韦尔转债	459,799.89	0.83
17	113047	旗滨转债	439,719.47	0.80
18	123104	卫宁转债	439,608.90	0.80
19	110056	亨通转债	427,589.01	0.77
20	111001	山玻转债	406,414.47	0.74
21	123115	捷捷转债	370,880.75	0.67
22	113619	世运转债	331,760.98	0.60
23	123122	富瀚转债	327,665.56	0.59
24	110062	烽火转债	276,459.86	0.50
25	123117	健帆转债	275,180.98	0.50
26	127040	国泰转债	260,574.69	0.47
27	123107	温氏转债	238,953.28	0.43
28	110083	苏租转债	223,945.64	0.41
29	110047	山鹰转债	173,058.09	0.31
30	128017	金禾转债	171,956.71	0.31
31	110048	福能转债	161,959.69	0.29
32	110079	杭银转债	160,361.49	0.29
33	127041	弘亚转债	140,967.77	0.26
34	127012	招路转债	139,357.06	0.25
35	128029	太阳转债	138,208.25	0.25
36	123121	帝尔转债	134,406.38	0.24
37	123123	江丰转债	111,106.54	0.20
38	110061	川投转债	108,191.54	0.20
39	113630	赛伍转债	86,010.46	0.16
40	128046	利尔转债	82,062.17	0.15

41	127018	本钢转债	40,118.84	0.07
42	113579	健友转债	1,266.51	0.00

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前十名股票不存在流通受限的情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华丰利债券A	新华丰利债券C
本报告期期初基金份额总额	9,540,917.23	35,149,015.80
报告期期间基金总申购份额	38,668.54	187,750.88
减：报告期期间基金总赎回份额	36,777.09	1,174,678.28
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,542,808.68	34,162,088.40

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	新华丰利债券A	新华丰利债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	3,988,033.51	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,988,033.51	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	41.79	-

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末有影响投资者决策的其他重要信息。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新华丰利债券型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华丰利债券型证券投资基金之法律意见书
- (三) 《新华丰利债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 《新华丰利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《新华丰利债券型证券投资基金招募说明书》
- (七) 《新华丰利债券型证券投资基金产品资料概要》(更新)
- (八) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (九) 基金托管人业务资格批件及营业执照

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二二年七月二十日