

# 新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

**2023 年中期报告**

**2023 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：广发银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 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。本中期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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
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.....	20
<b>5 托管人报告</b> .....	20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	20
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.....	20
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	21
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	21
6.1 资产负债表.....	21
6.2 利润表.....	22
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	23
6.4 报表附注.....	25
<b>7 投资组合报告</b> .....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 本报告期投资基金情况.....	46
7.13 投资组合报告附注.....	47
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	49

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>50</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	51
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.9 其他重大事件 .....	53
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>54</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	新华安享惠金定期债券	
基金主代码	519160	
交易代码	519160	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 11 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	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,518,669.60 份	
下属分级基金的基金简称	新华安享惠金定期债券 A 类	新华安享惠金定期债券 C 类
下属分级基金的交易代码	519160	519161
报告期末下属分级基金的份额总额	21,139,083.89 份	4,379,585.71 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和增强基金资产流动性的基础上，力争获取超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：期限配置策略、利率预期策略、类属品种配置策略以及证券选择策略。采用定量与定性相结合的研究方法，深入分析市场利率发展方向、期限结构变化趋势、信用主体评级水平以及单个债券的投资价值，积极主动进行类属品种配置及个券选择，谋求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、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	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	顾洪峰
	联系电话	010-68779688	010-65169885
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	guhongfeng@cgbchina.com.cn
客户服务电话		4008198866	4008308003
传真		010-68779528	010-65169555
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号	广州市越秀区东风东路713号

	力帆中心2号楼19层	
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	北京市东城区东长安街甲2号 广发银行大厦
邮政编码	400010	100005
法定代表人	于春玲	王凯

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	新华安享惠金定期债券 A 类	新华安享惠金定期债券 C 类
本期已实现收益	-12,663,813.19	-132,119.26
本期利润	14,883,474.02	136,366.62
加权平均基金份额本期利润	0.0298	0.0272
本期加权平均净值利润率	3.00%	2.76%
本期基金份额净值增长率	3.00%	2.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	新华安享惠金定期债券 A 类	新华安享惠金定期债券 C 类
期末可供分配利润	-370,144.40	-107,809.72
期末可供分配基金份额利润	-0.0175	-0.0246
期末基金资产净值	21,223,719.82	4,365,913.40
期末基金份额净值	1.0040	0.9969
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	新华安享惠金定期债券 A 类	新华安享惠金定期债券 C 类
基金份额累计净值增长率	77.16%	71.05%

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

新华安享惠金定期债券 A 类

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	0.27%	0.10%	0.22%	0.00%	0.05%	0.10%
过去三个月	0.83%	0.10%	0.68%	0.00%	0.15%	0.10%
过去六个月	3.00%	0.09%	1.35%	0.00%	1.65%	0.09%
过去一年	0.08%	0.16%	2.74%	0.00%	-2.66%	0.16%
过去三年	1.92%	0.15%	8.44%	0.00%	-6.52%	0.15%
自基金合同生效起至今	77.16%	0.14%	32.72%	0.00%	44.44%	0.14%

新华安享惠金定期债券 C 类

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	0.24%	0.10%	0.22%	0.00%	0.02%	0.10%
过去三个月	0.74%	0.11%	0.68%	0.00%	0.06%	0.11%
过去六个月	2.80%	0.10%	1.35%	0.00%	1.45%	0.10%
过去一年	-0.28%	0.16%	2.74%	0.00%	-3.02%	0.16%
过去三年	0.85%	0.15%	8.44%	0.00%	-7.59%	0.15%
自基金合同生效起至今	71.05%	0.14%	32.72%	0.00%	38.33%	0.14%

注：1、本基金债券投资部分的业绩比较基准采用一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

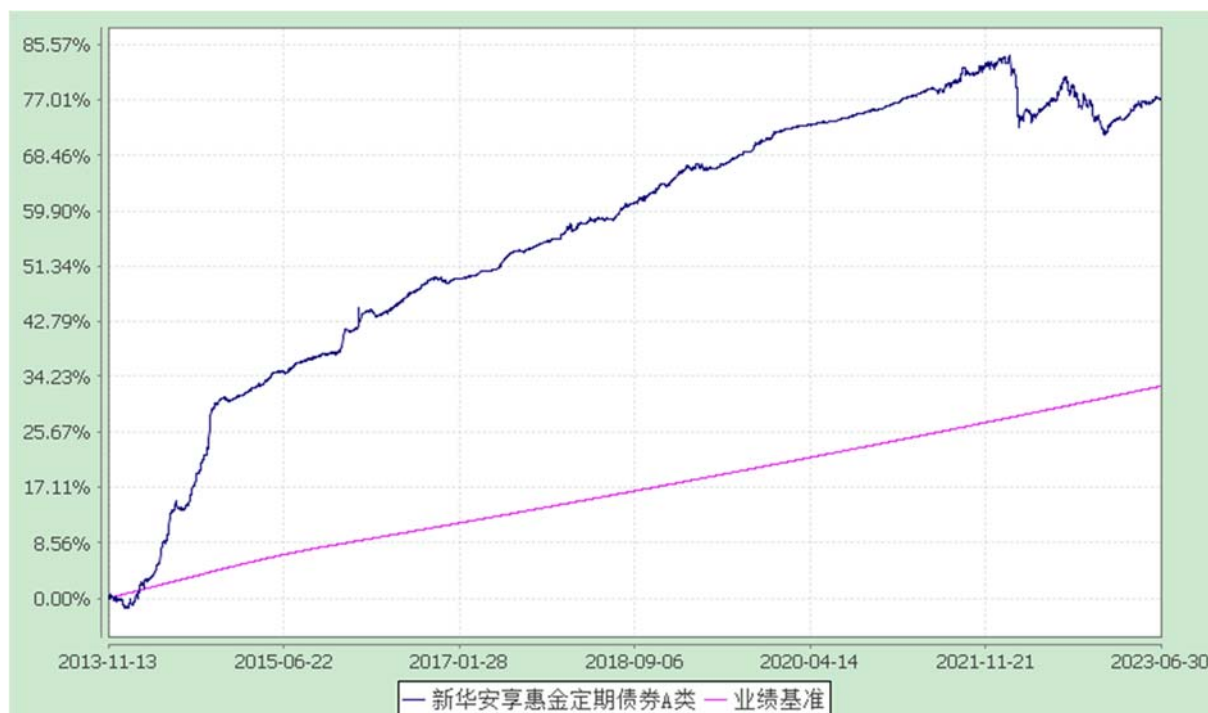
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

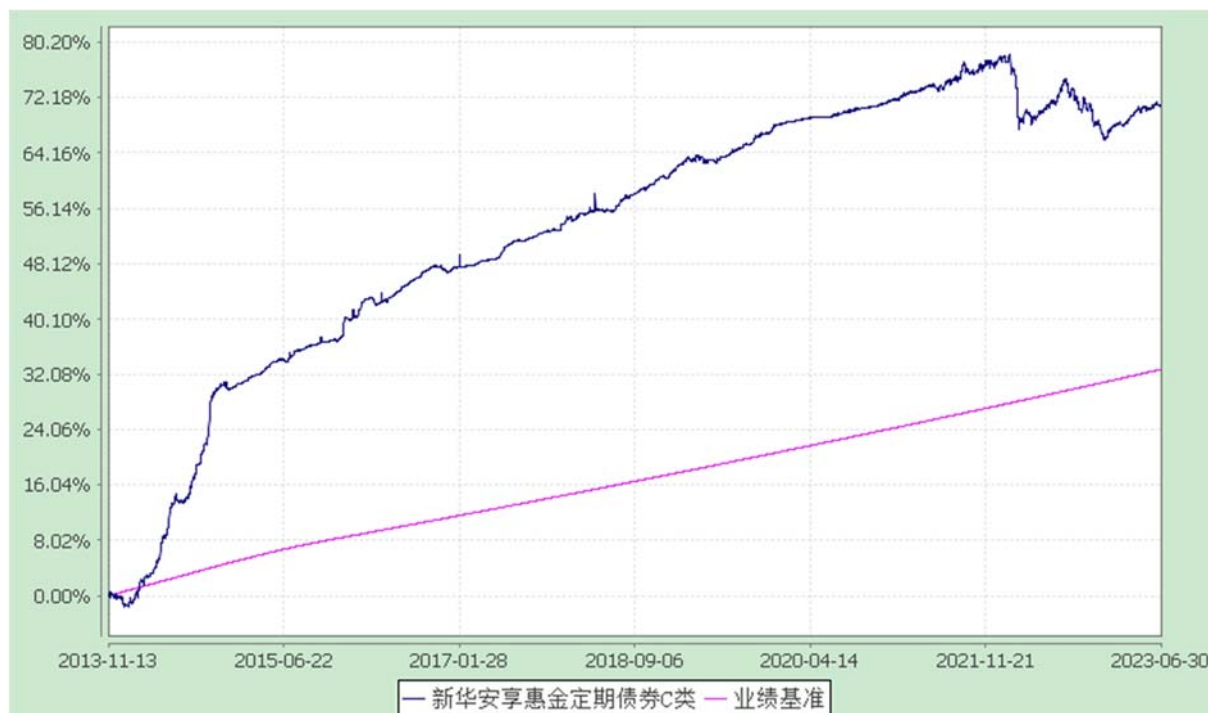
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 11 月 13 日至 2023 年 6 月 30 日)

新华安享惠金定期债券 A 类



新华安享惠金定期债券 C 类



注：1、本基金于 2013 年 11 月 13 日成立；

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 2023 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十八只开放式基金，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、新华鑫动力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、新华丰利债券型证券投资基金、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、新华鑫泰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、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金。

#### 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		
郑毅	本基金基金经理，总经理助理兼固定收益投资部总监，新华鑫日享中短债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、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理。	2022-09-29	-	12	学士，历任天风证券股份有限公司固定收益总部交易员、固收投资部副总经理、资管分公司策略投资一部总经理、资管分公司总经理助理。
万昱东	本基金基金经理助理，新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、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助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基	2022-12-13	-	5	统计学硕士，历任天风证券固定收益总部分析师。

	<p>金经理助理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经</p>				
--	--	--	--	--	--

	理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理。				
杨卓谕	本基金基金经理助理，新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、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助理、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助理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金	2022-12-13	-	5	金融硕士。曾任职于天风证券机构投顾总部产品助理，投资经理。

	<p>基金经理助理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理。</p>				
朱韦康	本基金基金经理助理，新华	2022-12-28	-	6	经济学博士，历任中金公司固定收益分析师，建信信托宏观策略投资

	<p>活期添利货币市场基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、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助理、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助理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券</p>				<p>和资产配置研究。</p>
--	---	--	--	--	-----------------

	型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理。				
李晓然	本基金基金经理助理，新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、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助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基	2021-03-01	2022-02-22	10	金融与投资硕士，历任大公国际资信评估有限公司分析师、行业组长、经理。

	<p>金经理助理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经</p>				
--	--	--	--	--	--



	理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理。				
--	---	--	--	--	--

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》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4、本基金基金经理助理万显东、杨卓谕于 2023 年 7 月 5 日离任。

#### 4.1.3 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

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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安享惠金定期开放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》、《新华安享惠金定期开放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

海外方面，2023 年上半年美国经济即使经历硅谷银行的风波，依旧表现坚韧，与市场去年底预期的衰退情景不符。二季度 GDP 环比超预期增长 0.6%，主要得益于三个方面因素：一是就业市场偏紧，有利于劳动者收入分配，保持消费者信心；二是美国服务业消费温和扩张，耐用品消费则受益于财政补贴；三是企业投资支出增加，比如半导体企业厂房建设、其他行业的交运设备采购。因此，美联储上半年未降息，美债市场则在宽松与紧缩预期之间反复，利率高位震荡。3 月硅谷银行事件后 10 年期美债利率回落，但该事件对实体部门造成的影响有限，5 月开始 10Y 美债也出现了反弹。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0040 元，本报告期份额净值增长率为 3.00%，同期比较基准的增长率为 1.35%；本基金 C 类份额净值为 0.9969 元，本报告期份额净值增长率为 2.80%，同期比较基准的增长率为 1.35%。

#### 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，对于海外通胀的判断仍然至关重要。虽然需求侧的韧性继续提升通胀，但由于供给侧的改善，新涨价的幅度会弱于去年，同比效应下通胀数据会逐步走低，缓解美联储政策的约束。从中期看，市场期望的降息周期的开启还需基本面催化，尤其是就业市场和服务业是否出现转冷的信号。从路径推演的角度，第一种可能性是下半年没有降息，美债依旧维持高位震荡，短期数据的波动会影响市场的预期。第二种可能性是美债利率回落至区间低点，相应需要去评估下行空间，留意美元走强带来了汇率压力。

国内方面，上半年市场对经济基本面的判断经历了从“强预期，弱现实”转变为“弱预期、弱现实”的过程，总量结构在基数效应下有所恢复，但是表征价格因子的 CPI 和 PPI 数据相对低迷，核心问题仍在于经济内部结构性的需求不足。具体来看，地产行业对经济拖累较大，销售低迷，新开工投资下降。基建投资继续托底，出口数据出现回落。居民消费仍主要集中在必选实物，服务业增长略低于预期。此外，由于一季度企业有一定补库，导致二季度预期转弱时不得不通过降价出清库存，致使收入和预期的进一步回落。面对基本面预期的走弱，国内资本市场的反应强烈且迅速，黑色商品价格快速下跌，十年国债利率从 2.8% 回落至 2.65% 附近，人民币汇率在内外部负面冲击下出现了一定幅度的贬值。政策方面，货币政策先行，人民银行在 6 月中旬下调了政策利率。

展望下半年国内债市：一方面，虽然需求问题仍然突出，但政策渐进式的发力能够一定程度上扭转悲观预期。从库存角度看，经过二季度的价格出清，供需已重新回到一个新的均衡位置，短期内利率下行空间有限。另一方面，政策的变化虽然对债市有短期扰动，但压力不会过大。政策不会简单“大水漫灌”刺激，融资需求回升需要时间，经济修复的也更多会呈现渐进式的节奏。

操作层面，当前利率的绝对收益处于历史低位，主要利率品种的曲线已相当平坦，但融资需求大幅反弹尚需时间，对应利率向上调整的压力较小。在低位震荡的环境中，债券部分的仓位不应过早离场，当前可采取哑铃型配置，兼顾组合的流动性。政策力度变化带来的短期市场预期的转变，可能会为下半年债券市场带来较好的买点。

2023 年上半年中证转债上涨了 3.5%，主要涨幅集中在疫情常态化之后的一月，2-6 月赚钱效应降低，特别是二季度以来跟随权益市场呈现震荡走势，溢价率中枢小幅抬升。从行业来看，TMT 与中特估是上半年的主线。23 年上半年出现了蓝盾转债及搜特转债的退市事件，对市场情绪产生一定影响，但在当前资产荒及债市支撑下对情绪冲击有限。从操作层面来看，我们在转债层面通过主观判断+量化择行业及择券的思路，采用行业轮动叠加精选个券的策略，保持了较为稳定的业绩回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值小组，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

本报告期末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净值低于五千万元的情形。

### 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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告 等数据真实、准确和完整。

## 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：新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,405,208.10	3,762,507.35
结算备付金		1,889,722.10	1,472,586.83
存出保证金		62,478.25	8,216.86
交易性金融资产	6.4.7.2	18,391,712.84	486,051,296.65
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		18,391,712.84	486,051,296.65
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,000,000.00	12,995,073.85
应收清算款		-	36,863,267.94
应收股利		-	-
应收申购款		99.94	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	460,878.90
资产总计		32,749,221.23	541,613,828.38
<b>负债和净资产</b>			
	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>			
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		-	37,328,560.56
应付清算款		6,647,527.05	-

应付赎回款		175,710.73	-
应付管理人报酬		155,301.54	172,152.37
应付托管费		38,825.39	43,038.10
应付销售服务费		1,426.98	1,456.46
应付投资顾问费		-	-
应交税费		17,481.31	36,494.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	123,315.01	220,579.23
负债合计		7,159,588.01	37,802,281.16
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	25,518,669.60	516,841,616.57
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.11	70,963.62	-13,030,069.35
净资产合计		25,589,633.22	503,811,547.22
负债和净资产总计		32,749,221.23	541,613,828.38

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0040 元，基金份额 21,139,083.89 份；C 类基金份额净值 0.9969 元，基金份额 4,379,585.71 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>16,692,183.49</b>	<b>-20,047,387.49</b>
1.利息收入		358,529.57	1,095,335.00
其中：存款利息收入	6.4.7.12	53,150.48	134,118.86
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		305,379.09	961,216.14
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-11,482,119.19	-3,346,984.80
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-11,482,119.19	4,584,854.86
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-7,931,839.66
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-

股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		27,815,773.09	-17,811,620.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	0.02	15,883.11
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,672,342.85</b>	<b>3,095,957.95</b>
1. 管理人报酬		1,003,519.18	1,248,694.82
2. 托管费		250,879.80	312,173.72
3. 销售服务费		8,597.10	9,316.38
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		274,485.71	1,357,683.53
其中：卖出回购金融资产支出		274,485.71	1,357,683.53
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		17,232.11	50,910.55
8. 其他费用	6.4.7.22	117,628.95	117,178.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>15,019,840.64</b>	<b>-23,143,345.44</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>15,019,840.64</b>	<b>-23,143,345.44</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>15,019,840.64</b>	<b>-23,143,345.44</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	516,841,616.57	-	-13,030,069.35	503,811,547.22
二、本期期初净资产（基金净值）	516,841,616.57	-	-13,030,069.35	503,811,547.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-491,322,946.97	-	13,101,032.97	-478,221,914.00
（一）、综合收益总额	-	-	15,019,840.64	15,019,840.64
（二）、本期基金	-491,322,946.97	-	-1,918,807.67	-493,241,754.

份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				64
其中：1.基金申购款	110.55	-	0.38	110.93
2.基金赎回款	-491,323,057.52	-	-1,918,808.05	-493,241,865.57
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	25,518,669.60	-	70,963.62	25,589,633.22
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	650,938,853.25	-	24,162,046.76	675,100,900.01
二、本期期初净资产（基金净值）	650,938,853.25	-	24,162,046.76	675,100,900.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-134,097,236.68	-	-22,506,732.93	-156,603,969.61
（一）、综合收益总额	-	-	-23,143,345.44	-23,143,345.44
（二）、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）	-134,097,236.68	-	636,612.51	-133,460,624.17
其中：1.基金申购款	5,590.59	-	-22.64	5,567.95
2.基金赎回款	-134,102,827.27	-	636,635.15	-133,466,192.12
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	516,841,616.57	-	1,655,313.83	518,496,930.40



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：于春玲，主管会计工作负责人：于春玲，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

新华安享惠金定期开放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[2013] 1141 号文核准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2013 年 10 月 8 日至 2013 年 11 月 8 日向社会公开募集,设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计 219,016,876.34 份,有效认购户数为 2,792 户,并经国富浩华会计师事务所(特殊普通合伙)国浩验字[2013]404A0015 号验资报告予以验证。2013 年 11 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,存续期不设定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国广发银行股份有限公司。

根据《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、地方政府债、城投债、金融债、企业债(含中小企业私募债)、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产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。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。本基金可参与可转换债券投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金各类资产的投资比例范围为:固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%;现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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 2023 年 8 月 29 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,按照财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协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最近一期年度报告相一致，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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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政策的补充通知》、财税[2016]140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[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳

增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,405,208.10
等于：本金	7,390,483.13
加：应计利息	14,724.97
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	7,405,208.10

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,379,804.09	21,251.41	8,365,893.17	-35,162.33
	银行间市场	10,012,360.00	25,819.67	10,025,819.67	-12,360.00
	合计	18,392,164.09	47,071.08	18,391,712.84	-47,522.33
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		18,392,164.09	47,071.08	18,391,712.84	-47,522.33

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,000,000.00	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末持有债权投资。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末持有其他债权投资。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末持有其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	15,136.06
其中：交易所市场	-
银行间市场	15,136.06
应付利息	-
账户维护费	9,000.00
上海证券报	59,507.37
审计费	39,671.58
合计	123,315.01

**6.4.7.10 实收基金**

新华安享惠金定期债券 A 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	511,818,580.00	511,818,580.00
本期申购	110.55	110.55
本期赎回（以“-”号填列）	-490,679,606.66	-490,679,606.66
本期末	21,139,083.89	21,139,083.89

新华安享惠金定期债券 C 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	5,023,036.57	5,023,036.57
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-643,450.86	-643,450.86
本期末	4,379,585.71	4,379,585.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 未分配利润

新华安享惠金定期债券 A 类

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	3,596,881.69	-16,474,603.90	-12,877,722.21
本期利润	-12,663,813.19	27,547,287.21	14,883,474.02
本期基金份额交易产生的变动数	8,696,787.10	-10,617,902.98	-1,921,115.88
其中：基金申购款	-1.95	2.33	0.38
基金赎回款	8,696,789.05	-10,617,905.31	-1,921,116.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-370,144.40	454,780.33	84,635.93

新华安享惠金定期债券 C 类

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	7,597.61	-159,944.75	-152,347.14
本期利润	-132,119.26	268,485.88	136,366.62
本期基金份额交易产生的变动数	16,711.93	-14,403.72	2,308.21
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	16,711.93	-14,403.72	2,308.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-107,809.72	94,137.41	-13,672.31

#### 6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	39,708.44
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	13,442.04
其他	-
合计	53,150.48

注：本项结算备付金利息收入中包含了保证金利息收入。

#### 6.4.7.13 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.14 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	7,231,624.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-18,713,743.35
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	-11,482,119.19
----	----------------

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,611,234,059.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,616,490,581.79
减：应计利息总额	13,382,737.21
减：交易费用	74,483.85
买卖债券差价收入	-18,713,743.35

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	27,815,773.09
——股票投资	-
——债券投资	27,815,773.09
——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	27,815,773.09

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	0.02
合计	0.02

#### 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	-
证券出借违约金	-
上清所证书使用费	600.00
账户维护费	17,850.00
上海证券报	59,507.37
合计	117,628.95

### 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 2023 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

截至财务报告签发日，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、基金发起人

广发银行股份有限公司	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

本报告期及上年度可比期间本基金均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

本报告期及上年度可比期间本基金均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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
恒泰证券股份有限公司	1,611,202,233.59	100.00%	410,172,215.38	100.00%

###### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	1,564,413,000.00	100.00%	2,764,400,000.00	100.00%

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间本基金均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
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,003,519.18	1,248,694.82
其中：支付销售机构的客户维护费	23,012.24	28,173.40

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.4% 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×0.4%/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
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	250,879.80	312,173.72

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.1% 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×0.1%/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		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华安享惠金定期债券 A 类	新华安享惠金定期债券 C 类	合计
广发银行股份有限公司	-	6,009.68	6,009.68
新华基金管理股份有限公司	-	9.20	9.20
合计	-	6,018.88	6,018.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华安享惠金定期债券 A 类	新华安享惠金定期债券 C 类	合计

新华基金管理股份有限公司	-	12.69	12.69
广发银行股份有限公司	-	6,608.87	6,608.87
合计	-	6,621.56	6,621.56

注：本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.35% 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×0.35%/当年天数。

#### 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未参与证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未参与证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金

##### 6.4.10.5.2 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

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022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
广发银行股份有限公司	7,405,208.10	39,708.44	7,764,433.91	97,085.35

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 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。

#### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本报告期及上年度可比期间，本基金未参与基金投资。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至报告期期末本基金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

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金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 2023 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期期末未参与转融通证券出借业务。

#### 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。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。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；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

#### 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 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,025,819.67	-
合计	10,025,819.67	-

注：上年末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 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 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	1,195,680.56	296,294,839.55
AAA 以下	7,170,212.61	139,660,236.04
未评级	-	50,096,221.06
合计	8,365,893.17	486,051,296.65

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

#### 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。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。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。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。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 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 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	7,405,208.10	-	-	-	7,405,208.10
结算备付金	1,889,722.10	-	-	-	1,889,722.10
存出保证金	62,478.25	-	-	-	62,478.25
交易性金融资产	10,326,997.12	5,804,687.52	2,260,028.20	-	18,391,712.84
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	99.94	99.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,684,405.57	5,804,687.52	2,260,028.20	99.94	32,749,221.23
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	6,647,527.05	6,647,527.05
应付赎回款	-	-	-	175,710.73	175,710.73
应付管理人报酬	-	-	-	155,301.54	155,301.54
应付托管费	-	-	-	38,825.39	38,825.39
应付销售服务费	-	-	-	1,426.98	1,426.98
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	17,481.31	17,481.31
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	123,315.01	123,315.01
负债总计	-	-	-	7,159,588.01	7,159,588.01
利率敏感度缺口	24,684,405.57	5,804,687.52	2,260,028.20	-7,159,488.07	25,589,633.22
<b>上年度末</b>					
<b>2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	3,762,507.35	-	-	-	3,762,507.35
结算备付金	1,472,586.83	-	-	-	1,472,586.83
存出保证金	8,216.86	-	-	-	8,216.86
交易性金融资产	122,636,980.35	195,983,727.25	167,430,589.05	-	486,051,296.65



					5
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	12,995,073.85	-	-	-	12,995,073.85
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	36,863,267.94	36,863,267.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	460,878.90	460,878.90
资产总计	140,875,365.24	195,983,727.25	167,430,589.05	37,324,146.84	541,613,828.38
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	37,328,560.56	-	-	-	37,328,560.56
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	172,152.37	172,152.37
应付托管费	-	-	-	43,038.10	43,038.10
应付销售服务费	-	-	-	1,456.46	1,456.46
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	36,494.44	36,494.44
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	220,579.23	220,579.23
负债总计	37,328,560.56	-	-	473,720.60	37,802,281.16
利率敏感度缺口	103,546,804.68	195,983,727.25	167,430,589.05	36,850,426.24	503,811,547.22

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 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：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	-94,894.22	-4,703,335.06
	市场利率下降 25.00 bp	95,953.08	4,811,624.94

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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债券,因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	18,391,712.8 4	71.87	486,051,296.6 5	96.47
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	18,391,712.8	71.87	486,051,296.6	96.47

	4		5	
--	---	--	---	--

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	7,292,261.17
第二层次	11,099,451.67
第三层次	-
合计	18,391,712.84

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据《企业会计准则第 22 号-金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7 号）、《企业会计准则第 23 号-金融资产转移》（财会〔2017〕8 号）、《企业会计准则第 24 号-套期会计》（财会〔2017〕9 号）、《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》（财会〔2017〕14 号）（统称“新金融工具准则”）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号）等相关规定，自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具准则，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

## 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,391,712.84	56.16
	其中：债券	18,391,712.84	56.16
	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	5,000,000.00	15.27
	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	9,294,930.20	28.38
8	其他各项资产	62,578.19	0.19
9	合计	32,749,221.23	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	央行票据	-	-
3	金融债券	10,025,819.67	39.18
	其中：政策性金融债	10,025,819.67	39.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,365,893.17	32.69
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	18,391,712.84	71.87

#### 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	230206	23 国开 06	100,000	10,025,819.67	39.18
2	123170	南电转债	8,000	1,073,632.00	4.20
3	128081	海亮转债	1,490	190,049.30	0.74
4	113021	中信转债	1,650	189,939.14	0.74
5	110090	爱迪转债	1,360	189,685.68	0.74

#### 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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同约定不能投资股指期货。

#### 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

本基金合同中尚无国债期货的投资政策。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

#### 7.12 本报告期投资基金情况

##### 7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末无基金投资。

### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期内本基金投资的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。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内，本基金无股票投资。

#### 7.13.3 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	62,478.25
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	99.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,578.19

#### 7.13.4 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	123170	南电转债	1,073,632.00	4.20
2	128081	海亮转债	190,049.30	0.74
3	113021	中信转债	189,939.14	0.74
4	110090	爱迪转债	189,685.68	0.74
5	113047	旗滨转债	188,742.18	0.74
6	110045	海澜转债	188,693.71	0.74
7	127040	国泰转债	188,640.48	0.74
8	127027	能化转债	188,159.29	0.74
9	113619	世运转债	175,474.09	0.69

10	127036	三花转债	171,839.34	0.67
11	123158	宙邦转债	159,657.71	0.62
12	128136	立讯转债	142,897.62	0.56
13	113651	松霖转债	112,825.86	0.44
14	127020	中金转债	112,785.26	0.44
15	110043	无锡转债	112,537.46	0.44
16	118023	广大转债	112,519.45	0.44
17	128048	张行转债	112,113.32	0.44
18	128034	江银转债	112,090.22	0.44
19	110063	鹰 19 转债	112,085.36	0.44
20	127028	英特转债	111,985.75	0.44
21	110047	山鹰转债	111,912.72	0.44
22	110053	苏银转债	111,887.39	0.44
23	128119	龙大转债	111,723.62	0.44
24	127070	大中转债	111,656.18	0.44
25	110079	杭银转债	111,564.38	0.44
26	113049	长汽转债	111,560.86	0.44
27	127063	贵轮转债	111,339.24	0.44
28	113058	友发转债	111,313.48	0.43
29	113056	重银转债	111,295.44	0.43
30	127018	本钢转债	111,129.30	0.43
31	128134	鸿路转债	110,707.83	0.43
32	127032	苏行转债	110,665.67	0.43
33	113050	南银转债	110,332.86	0.43
34	113530	大丰转债	100,350.20	0.39
35	123048	应急转债	100,010.70	0.39
36	127037	银轮转债	99,881.43	0.39
37	113534	鼎胜转债	99,632.31	0.39
38	127074	麦米转 2	99,497.96	0.39
39	110077	洪城转债	99,458.85	0.39
40	113626	伯特转债	99,201.30	0.39
41	113063	赛轮转债	98,761.30	0.39
42	113588	润达转债	97,703.44	0.38
43	127029	中钢转债	96,913.38	0.38
44	123075	贝斯转债	94,162.93	0.37
45	113563	柳药转债	78,123.45	0.31
46	113025	明泰转债	77,547.40	0.30
47	127038	国微转债	77,196.69	0.30
48	123104	卫宁转债	76,796.49	0.30
49	123035	利德转债	76,796.10	0.30
50	128141	旺能转债	76,755.75	0.30
51	128135	洽洽转债	76,567.86	0.30
52	127005	长证转债	76,549.77	0.30
53	113584	家悦转债	76,525.55	0.30



54	123071	天能转债	76,386.53	0.30
55	123151	康医转债	76,101.32	0.30
56	113045	环旭转债	76,047.72	0.30
57	123114	三角转债	75,966.60	0.30
58	127030	盛虹转债	75,961.69	0.30
59	123145	药石转债	75,918.16	0.30
60	113039	嘉泽转债	75,891.56	0.30
61	113051	节能转债	75,667.89	0.30
62	110088	淮 22 转债	75,398.13	0.29
63	128109	楚江转债	75,397.61	0.29
64	118019	金盘转债	75,360.33	0.29
65	123107	温氏转债	75,357.62	0.29
66	113654	永 02 转债	74,932.28	0.29
67	128097	奥佳转债	74,242.72	0.29
68	113632	鹤 21 转债	71,062.60	0.28
69	111002	特纸转债	63,152.33	0.25
70	127024	盈峰转债	1,173.03	0.00

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无股票投资。

#### 7.13.6 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
新华安享惠金定期债券 A 类	569	37,151.29	377,781.31	1.79%	20,761,302.58	98.21%
新华安享惠金定	260	16,844.56	100,004.50	2.28%	4,279,581.21	97.72%

期债券 C 类						
合计	829	30,782.47	477,785.81	1.87%	25,040,883.79	98.13%

### 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	新华安享惠金定期债券 A 类	0.00	0.00%
	新华安享惠金定期债券 C 类	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	新华安享惠金定期债券 A 类	0
	新华安享惠金定期债券 C 类	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华安享惠金定期债券 A 类	0
	新华安享惠金定期债券 C 类	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	新华安享惠金定期债券 A 类	新华安享惠金定期债券 C 类
基金合同生效日（2013 年 11 月 13 日）基金份额总额	143,485,838.08	75,531,038.26
本报告期期初基金份额总额	511,818,580.00	5,023,036.57
本报告期基金总申购份额	110.55	-
减：本报告期基金总赎回份额	490,679,606.66	643,450.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	21,139,083.89	4,379,585.71

## 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

2023 年 2 月 28 日，翟晨曦女士离任公司董事长，于春玲女士代任公司董事长，刘征宇先生由于个人原因不再担任副总经理。2023 年 3 月 23 日，崔凤廷先生担任公司副总经理。2023 年 4 月，公司法定代表人变更为于春玲女士。2023 年 6 月 28 日，于春玲女士担任公司董事长、代任总经理，张宗友先生离任公司联席董事长，崔凤廷先生担任公司董事会秘书。

本报告期因第二届董事会任期届满，经公司 2023 年第二次股东大会审议通过，选举于春玲女士、张宗友先生、李磊先生、匡双礼先生、张坤女士、徐经长先生担任公司第三届董事会董事，其中匡双礼先生、张坤女士、徐经长先生为独立董事。卢东亮先生担任非职工监事，王建岭先生、孙义女士担任职工监事。2023 年 7 月 20 日，卢东亮先生担任监事会主席。

本报告期基金托管人无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人与原深圳办公区所租房屋的房东黄淑娴与二房东（承租人）之间存在房屋占用费的纠纷案件，该案件二审判决作出，管理人需支付房屋使用费，二房东收取的房租应当退回。基金管理人专户产品众富 1 号交易对手湖北蕲春农商行对公司发起诉讼，目前该案件已申请撤诉。

本报告期末有涉及基金财产、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

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

## 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	
恒泰证券	2	-	-	-	-	-

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2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
恒泰证券	1,611,202,233.59	100.00%	1,564,413,000.00	100.00%	-	-

## 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	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-01-20
2	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-01-20
3	新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-02-08
4	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台及网上直销交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-02-15
5	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、公司网站、电子信披网站	2023-03-02
6	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、公司网站、电子信披网站	2023-03-02
7	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、公司网站、电子信披网站	2023-03-24
8	新华基金管理股份有限公司旗下基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-03-30
9	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金 2022 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2023-03-30
10	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-04-21
11	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-04-21
12	新华基金管理股份有限公司关于公司法定代	中国证券报、公司网站、	2023-04-25

	表人变更的公告	电子信披网站	
13	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-20
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-06-29
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
16	新华基金管理股份有限公司关于公司董事变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
17	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、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
18	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、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
19	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、公司网站、电子信披网站	2023-06-30

## 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	20230101-20230628	487,581,187.91	-	487,581,187.91	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金每年开放一次申购和赎回，投资者需在开放期提出申购赎回申请，在非开放期间将无法按照基金份额净值进行申购和赎回。开放期如果出现较大数额的净赎回申请，则使基金资产变现困难，基金可能面临一定的流动性风险，存在着基金份额净值波动的风险。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无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安享惠金定期开放债券型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金之法律意见书

- (三) 新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金托管协议
- (四) 新华安享惠金定期开放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) 《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金招募说明书》（更新）
- (七) 《新华安享惠金定期开放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
- (十) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (十一) 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

二〇二三年八月三十日