

# 新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 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：二〇二一年八月二十七日

## 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 2021 年 8 月 26 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 2021 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.....	6
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> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>7 投资组合报告</b> .....	58
7.1 期末基金资产组合情况.....	58
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	60
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.....	66
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
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.....	69
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.....	70
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.....	70
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	71
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.11 投资组合报告附注.....	72
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	75
8.3 末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	77
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>78</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>79</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	79
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 .....	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	79
10.4 基金投资策略的改变 .....	79
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	79
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 .....	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	79
10.8 其他重大事件 .....	80
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>82</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>82</b>
12.1 备查文件目录 .....	83
12.2 存放地点 .....	83
12.3 查阅方式 .....	83

## 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	650,176,056.76 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	644,810,651.91 份	5,365,404.85 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	戴辉
	联系电话	010-68779688	010-65169958
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	daihui@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，北京市海 淀区西三环北路11号海通时代 商务中心C1座	北京市西城区菜市口大街1号 院2号楼信托大厦
邮政编码	400010	100053
法定代表人	翟晨曦	王滨

## 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（2021年1月1日至2021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	28,018,072.93	119,324.20
本期利润	25,188,571.71	97,362.71
加权平均基金份额本期利润	0.0170	0.0135
本期加权平均净值利润率	1.65%	1.32%
本期基金份额净值增长率	1.42%	1.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021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	7,927,617.53	59,558.33
期末可供分配基金份额利润	0.0123	0.0111
期末基金资产净值	660,792,307.61	5,492,843.76
期末基金份额净值	1.0248	1.0238
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
	新华安享惠金定期债券	新华安享惠金定期债券 C

	A 类	类
基金份额累计净值增长率	78.55%	73.62%

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	-0.12%	0.05%	0.22%	0.00%	-0.34%	0.05%
过去三个月	0.48%	0.05%	0.68%	0.00%	-0.20%	0.05%
过去六个月	1.42%	0.04%	1.35%	0.00%	0.07%	0.04%
过去一年	2.72%	0.04%	2.74%	0.00%	-0.02%	0.04%
过去三年	12.49%	0.06%	8.44%	0.00%	4.05%	0.06%
自基金合同生效起至今	78.55%	0.12%	25.74%	0.00%	52.81%	0.12%

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	-0.14%	0.07%	0.22%	0.00%	-0.36%	0.07%
过去三个月	0.39%	0.06%	0.68%	0.00%	-0.29%	0.06%
过去六个月	1.17%	0.06%	1.35%	0.00%	-0.18%	0.06%
过去一年	2.36%	0.06%	2.74%	0.00%	-0.38%	0.06%
过去三年	11.41%	0.28%	8.44%	0.00%	2.97%	0.28%
自基金合同生效起至今	73.62%	0.30%	25.74%	0.00%	47.88%	0.30%

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。

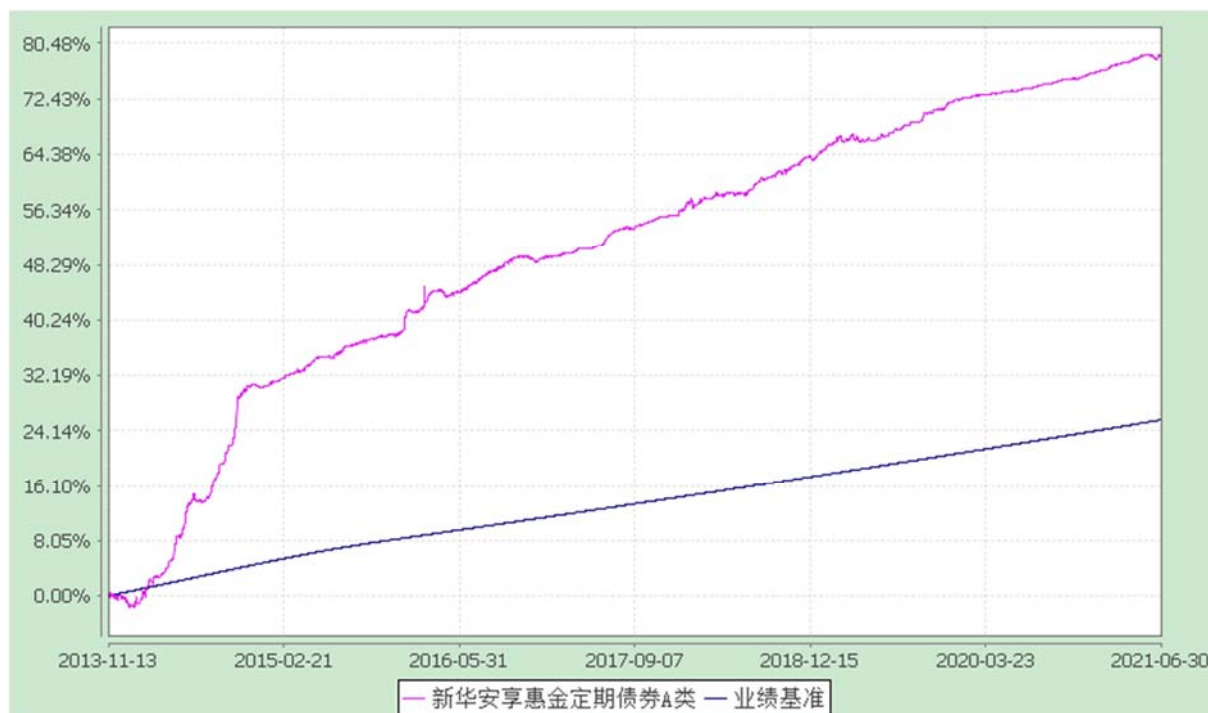
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金

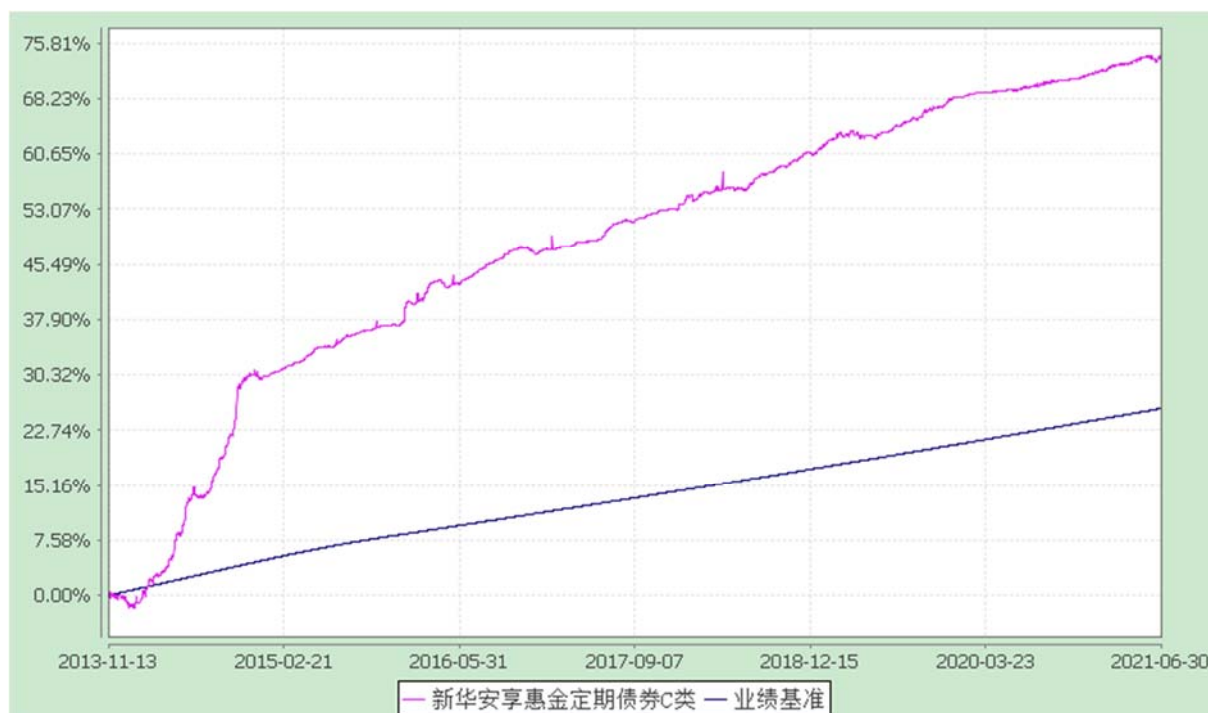
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 11 月 13 日至 2021 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 2021 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十二只开放式基金，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、新华恒稳添利债券型证券投资基金、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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马英	本基金基金经理，新华丰盈回报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。	2016-06-01	-	14	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。
曹巍浩	本基金基金经理，固定收益研究部总监、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理、新华双利债券型证券投资基金基金经理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华安享惠融 88 个月定期开放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、新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理。	2021-02-02	-	14	学士，历任德意志交易所集团数据与分析部 MNI 中国金融市场分析师，汤森路透中国债券和货币市场高级分析师，天风证券固收执行总经理和账户投资经理。

于泽雨	本基金基金经理，投资副总监、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理。	2013-11-13	2021-02-19	13	经济学博士，历任华安财产保险公司债券研究员、合众人寿保险公司债券投资经理。
张乃先	本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券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、新华增强债券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、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基	2020-06-03	-	6	经济学硕士，历任新华基金固定收益信用研究员、宏观研究员、高级宏观研究员。

	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、新华丰盈回报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、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理。				
于航	本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券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、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、	2020-06-03	-	6	统计学硕士，历任新华基金股票交易员，固定收益与平衡投资部研究员，从事宏观研究、策略研究、信用研究、转债研究等多个方向研究工作。

	<p>新华鑫回报混合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、新华鑫利灵活配置混合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、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报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、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理、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。</p>				
--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--

李晓然	本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡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、新华鑫利灵活配置混合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、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报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、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华壹诺	2021-03-01	-	8	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，新华基金固定收益信用研究员。
-----	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------	---	---	--------------------------------------------------

	宝货币市场基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理。				
--	-----------------------------------	--	--	--	--

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。

#### 4.1.3 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

2021 年上半年，中债新综合全价指数上涨 0.65%，一季度表现不及二季度；中证转债上涨 4.04%。本基金上半年以信用套息策略为主进行债券配置，同时持有一定比例的转债资产。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0248 元，本报告期份额净值增长率为 1.42%，同期比较基准的增长率为 1.35%；本基金 C 类份额净值为 1.0238 元，本报告期份额净值增长率为 1.17%，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 2021 年下半年，国内经济仍将处于回归常态化的进程中，由于年内 GDP 设定增速为 6%，实现的难度并不大。经济复苏的程度，要视消费和制造业投资的恢复情况而定。以联储为代表的发达国家央行走出宽松的大方向不会变，下半年是货币当局宝贵的政策窗口。国内货币政策既要稳健又要灵活精准，不会急转弯，且持续支持信贷流向制造业、中小微企业。

债券投资方面，由于广义流动性趋于供求关系改善，通胀目前看尚不会明显超越可容忍区间高端，下半年经济增速大概率放缓，我们将持续关注久期的机会。信用债方面，央行仍把守着底线思维，中高评级信用债存在一定套息空间。本基金将在保持既有风格的基础上，更加重视发行主体的基本面情况，将加大杠杆操作的力度，进一步增厚收益来源。

股票投资方面，大分化行情中，要更加注意落袋为安和对风格均衡的观察。高景气行业估值偏高，关注度较高的环境中，对于绝对收益产品要更加注重落袋为安，积小胜为大胜；留有一定的精力关注风格均衡的可能性和进展情况。



#### 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

本基金本报告期共进行一次分红。本次分红依据 2021 年 3 月 12 日本基金已实现的可分配利润，对权益登记在册的本基金份额持有人进行利润分配，权益登记日为 2021 年 3 月 19 日。A 类基金每 10 份派发 0.137 元，C 类基金每 10 份派发 0.121 元。

#### 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、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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	6,304,901.26	5,705,243.45
结算备付金		8,486,737.37	-
存出保证金		68,805.53	-
交易性金融资产	6.4.7.2	919,216,511.57	1,848,719,360.23
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		876,221,111.57	1,848,719,360.23
资产支持证券投资		42,995,400.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	38,800,139.40
应收证券清算款		899,143.37	-
应收利息	6.4.7.5	15,765,114.68	41,997,497.04
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		950,741,213.78	1,935,222,240.12
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<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		283,100,000.00	-
应付证券清算款		825,952.62	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		219,003.55	653,949.45
应付托管费		54,750.92	163,487.38
应付销售服务费		1,580.01	2,466.73
应付交易费用	6.4.7.7	25,228.01	26,434.96
应交税费		69,221.65	240,583.45
应付利息		52,146.70	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,178.95	200,000.00
负债合计		284,456,062.41	1,286,921.97
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	650,176,056.76	1,887,696,113.95
未分配利润	6.4.7.10	16,109,094.61	46,239,204.20
所有者权益合计		666,285,151.37	1,933,935,318.15
负债和所有者权益总计		950,741,213.78	1,935,222,240.12

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0248 元，基金份额 644,810,651.91 份；C 类基金份额净值 1.0238 元，基金份额 5365404.85 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>29,711,245.93</b>	<b>29,597,163.11</b>
1.利息收入		46,567,606.26	84,814,569.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	295,710.95	1,562,062.58
债券利息收入		43,364,770.02	81,745,978.21
资产支持证券利息收入		619,614.42	-

买入返售金融资产收入		2,287,510.87	1,506,528.28
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,012,753.14	-44,673,827.40
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-13,788,487.29	-44,673,827.40
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-224,265.85	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,851,462.71	-10,635,832.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,855.52	92,254.42
<b>减：二、费用</b>		<b>4,425,311.51</b>	<b>6,593,385.52</b>
1. 管理人报酬		3,064,286.29	4,714,210.64
2. 托管费		766,071.57	1,178,552.66
3. 销售服务费		12,835.49	16,396.01
4. 交易费用	6.4.7.18	23,401.53	67,235.86
5. 利息支出		274,040.92	208,408.68
其中：卖出回购金融资产支出		274,040.92	208,408.68
6.税金及附加		157,896.76	290,527.77
7. 其他费用	6.4.7.19	126,778.95	118,053.90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>25,285,934.42</b>	<b>23,003,777.59</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>25,285,934.42</b>	<b>23,003,777.59</b>

### 6.3 所有者权益（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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	1,887,696,113.95	46,239,204.20	1,933,935,318.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,285,934.42	25,285,934.42
三、本期基金份额交易产	-1,237,520,057.19	-29,567,635.77	-1,267,087,692.96

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	614,930,053.19	15,703,096.81	630,633,150.00
2.基金赎回款	-1,852,450,110.38	-45,270,732.58	-1,897,720,842.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-25,848,408.24	-25,848,408.24
五、期末所有者权益（基金净值）	650,176,056.76	16,109,094.61	666,285,151.37
项目	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020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）	2,588,300,727.54	198,602,217.69	2,786,902,945.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,003,777.59	23,003,777.59
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）	-700,764,721.24	-33,708,121.79	-734,472,843.03
其中：1.基金申购款	57,317,502.92	4,643,990.35	61,961,493.27
2.基金赎回款	-758,082,224.16	-38,352,112.14	-796,434,336.30
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）	-	-147,273,565.20	-147,273,565.20
五、期末所有者权益（基金净值）	1,887,536,006.30	40,624,308.29	1,928,160,314.59

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：翟晨曦，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, 存续期不限定, 本基金管理人为新华基金管理股份有限公司, 基金托管人为中国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 2021 年 8 月 26 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》、《新华安享惠金定期开放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**

本基金报告期末未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

#### 2、营业税、增值税、企业所得税

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

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

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



### 3、个人所得税

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	6,304,901.26
定期存款	-
其他存款	-
合计	6,304,901.26

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	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	700,346,671.27	698,771,511.57
	银行间市场	177,468,930.67	177,449,600.00
	合计	877,815,601.94	876,221,111.57
资产支持证券	43,246,232.18	42,995,400.00	-250,832.18
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	921,061,834.12	919,216,511.57	-1,845,322.55

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本报告期末未持有买入返售资产。

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,515.30
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	3,465.00
应收债券利息	14,679,991.92
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	-
应收出借证券利息	-
其他	1,080,142.46
合计	15,765,114.68

注：本项应收结算备付金利息中包含了应收保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	25,228.01
合计	25,228.01

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	108,178.95
合计	108,178.95

**6.4.7.9 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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,879,553,181.54	1,879,553,181.54
本期申购	614,876,902.46	614,876,902.46
本期赎回（以“-”号填列）	-1,849,619,432.09	-1,849,619,432.09
本期末	644,810,651.91	644,810,651.91

新华安享惠金定期债券 C 类

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	8,142,932.41	8,142,932.41
本期申购	53,150.73	53,150.73
本期赎回（以“-”号填列）	-2,830,678.29	-2,830,678.29
本期末	5,365,404.85	5,365,404.85

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 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	13,803,164.79	32,243,141.04	46,046,305.83
本期利润	28,018,072.93	-2,829,501.22	25,188,571.71
本期基金份额交易产生的变动数	-8,143,741.33	-21,359,601.65	-29,503,342.98
其中：基金申购款	5,168,923.58	10,533,002.12	15,701,925.70
基金赎回款	-13,312,664.91	-31,892,603.77	-45,205,268.68
本期已分配利润	-25,749,878.86	-	-25,749,878.86
本期末	7,927,617.53	8,054,038.17	15,981,655.70

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	51,791.67	141,106.70	192,898.37
本期利润	119,324.20	-21,961.49	97,362.71
本期基金份额交易产生的变动数	-13,028.16	-51,264.63	-64,292.79
其中：基金申购款	213.93	957.18	1,171.11
基金赎回款	-13,242.09	-52,221.81	-65,463.90
本期已分配利润	-98,529.38	-	-98,529.38
本期末	59,558.33	67,880.58	127,438.91

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	274,753.23
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	20,957.72
其他	-
合计	295,710.95

注：本项结算备付金利息收入中包含了保证金利息收入。

## 6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,936,438,491.60

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,849,973,895.54
减：应收利息总额	100,253,083.35
买卖债券差价收入	-13,788,487.29

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	52,446,119.12
减：卖出资产支持证券成本总额	50,398,318.90
减：应收利息总额	2,272,066.07
资产支持证券投资收益	-224,265.85

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

报告期末，本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生工具投资。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-2,851,462.71
——股票投资	-
——债券投资	-2,600,630.53
——资产支持证券投资	-250,832.18
——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	-2,851,462.71

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	7,855.52
合计	7,855.52

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	6,190.28
银行间市场交易费用	17,211.25
合计	23,401.53

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券账户维护费	27,000.00
汇划手续费	-
其他	600.00
合计	126,778.95

**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 2021 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,067,728,244.87	100.00%	59,223,649.99	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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	3,521,500,000.00	100.00%	1,113,000,000.00	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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,064,286.29	4,714,210.64
其中：支付销售机构的客户维护费	38,572.56	52,653.54

注：本基金自 2019 年 5 月 6 日起降低基金管理费率，由年费率 0.7%调至 0.4%。

2013 年 11 月 13 日至 2019 年 5 月 5 日，基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.7%/当年天数。

2019 年 5 月 6 日起，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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	766,071.57	1,178,552.66

注：本基金自 2019 年 5 月 6 日起降低基金托管费率，由年费率 0.2%调至 0.1%。

2013 年 11 月 13 日至 2019 年 5 月 5 日，基金托管费按前一日的基金资产净值 0.2%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×0.2%/当年天数。

2019 年 5 月 6 日起，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 2021年1月1日至2021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	-	9,147.63	9,147.63
新华基金管理股份有限公司	-	45.37	45.37
合计	-	9,193.00	9,193.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-	67.59	67.59
广发银行股份有限公司	-	11,154.93	11,154.93
合计	-	11,222.52	11,222.52

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 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用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

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020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	6,304,901.26	274,753.23	6,932,732.72	41,594.72

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

新华安享惠金定期债券 A 类

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2021-03-19	-	2021- 03-19	0.137	25,556,080.9 7	193,797.89	25,749,878.8 6	-
合计				0.137	25,556,080.9 7	193,797.89	25,749,878.8 6	-

新华安享惠金定期债券 C 类

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2021-03-19	-	2021- 03-19	0.121	70,221.31	28,308.07	98,529.38	-
合计				0.121	70,221.31	28,308.07	98,529.38	-

**6.4.12 期末（2021 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 2021 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 2021 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购。

**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	上年末

	2021年6月30日	2020年12月31日
A-1	0.00	290,964,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	123,955,900.00	791,010,000.00
合计	123,955,900.00	1,081,974,000.00

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，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

本期末及上年度末，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 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	653,988,764.98	370,802,057.73
AAA 以下	98,276,446.59	395,943,302.50
未评级	0.00	0.00
合计	752,265,211.57	766,745,360.23

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	42,995,400.00	-
AAA 以下	0.00	-
未评级	0.00	-
合计	42,995,400.00	-

注：上年度末，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

本期末及上年度末，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 2021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	6,304,901.26	-	-	-	6,304,901.26
结算备付金	8,486,737.37	-	-	-	8,486,737.37
存出保证金	68,805.53	-	-	-	68,805.53
交易性金融资产	425,594,732.99	421,627,325.70	71,994,452.88	-	919,216,511.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	899,143.37	899,143.37
应收利息	-	-	-	15,765,114.68	15,765,114.68

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	440,455,177.15	421,627,325.70	71,994,452.88	16,664,258.05	950,741,213.78
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	283,100,000.00	-	-	-	283,100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	825,952.62	825,952.62
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	219,003.55	219,003.55
应付托管费	-	-	-	54,750.92	54,750.92
应付销售服务费	-	-	-	1,580.01	1,580.01
应付交易费用	-	-	-	25,228.01	25,228.01
应交税费	-	-	-	69,221.65	69,221.65
应付利息	-	-	-	52,146.70	52,146.70
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	108,178.95	108,178.95
负债总计	283,100,000.00	-	-	1,356,062.41	284,456,062.41
利率敏感度缺口	157,355,177.15	421,627,325.70	71,994,452.88	15,308,195.64	666,285,151.37
<b>上年度末 2020 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	5,705,243.45	-	-	-	5,705,243.45
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,847,630,302.50	4,072.00	1,084,985.73	-	1,848,719,360.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资	38,800,139.40	-	-	-	38,800,139.40

产					
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	41,997,497.04	41,997,497.04
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,892,135,685.35	4,072.00	1,084,985.73	41,997,497.04	1,935,222,240.12
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	653,949.45	653,949.45
应付托管费	-	-	-	163,487.38	163,487.38
应付销售服务费	-	-	-	2,466.73	2,466.73
应付交易费用	-	-	-	26,434.96	26,434.96
应交税费	-	-	-	240,583.45	240,583.45
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	1,286,921.97	1,286,921.97
利率敏感度缺口	1,892,135,685.35	4,072.00	1,084,985.73	40,710,575.07	1,933,935,318.15

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

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
		市场利率上升 25.00 bp	-3,139,031.32

市场利率下降 25.00 bp	3,169,913.97	893,447.53
-----------------	--------------	------------

#### 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 2021年6月30日		上年度末 2020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	876,221,111.57	131.51	1,848,719,360.23	95.59
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	876,221,111.57	131.51	1,848,719,360.23	95.59

## 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	919,216,511.57	96.68
	其中：债券	876,221,111.57	92.16
	资产支持证券	42,995,400.00	4.52
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	14,791,638.63	1.56
8	其他各项资产	16,733,063.58	1.76
9	合计	950,741,213.78	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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	566,691,000.00	85.05
5	企业短期融资券	123,955,900.00	18.60
6	中期票据	53,493,700.00	8.03
7	可转债（可交换债）	132,080,511.57	19.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	876,221,111.57	131.51

#### 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	143067	17 广晟 02	450,000	45,040,500.00	6.76
2	136325	16 金地 01	300,000	30,267,000.00	4.54
3	112876	19 太阳 G1	300,000	30,213,000.00	4.53
4	012100866	21 新疆国投 SCP001	300,000	30,174,000.00	4.53
5	155071	18 首置 03	300,000	30,111,000.00	4.52

**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**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	179335	璟悦 01 优	200,000.00	20,012,000.00	3.00
2	169328	开新 10 优	200,000.00	19,984,000.00	3.00
3	169692	光耀 02A	30,000.00	2,999,400.00	0.45

**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**

本报告期末本基金无股指期货投资。

**7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本报告期末本基金无国债期货投资。

**7.11.3 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 本报告期末，本基金投资的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。

7.13.2 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之外的股票。

#### 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	68,805.53
2	应收证券清算款	899,143.37
3	应收股利	-
4	应收利息	15,765,114.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,733,063.58

#### 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	113011	光大转债	20,447,257.80	3.07
2	110053	苏银转债	13,251,298.40	1.99
3	113013	国君转债	11,516,772.90	1.73
4	110051	中天转债	9,146,209.50	1.37
5	110073	国投转债	7,520,312.20	1.13
6	113602	景 20 转债	6,734,259.00	1.01
7	110048	福能转债	5,926,944.60	0.89
8	110062	烽火转债	4,237,644.40	0.64
9	128029	太阳转债	3,886,471.30	0.58
10	113603	东缆转债	3,373,303.20	0.51
11	113044	大秦转债	2,981,302.70	0.45
12	127024	盈峰转债	2,853,659.40	0.43
13	113611	福 20 转债	2,574,466.40	0.39

14	127012	招路转债	2,239,816.81	0.34
15	128136	立讯转债	2,184,626.00	0.33
16	113605	大参转债	1,914,497.80	0.29
17	128134	鸿路转债	1,837,758.30	0.28
18	113616	韦尔转债	1,682,676.00	0.25
19	127027	靖远转债	1,598,339.08	0.24
20	123025	精测转债	1,587,809.70	0.24
21	110056	亨通转债	1,582,658.00	0.24
22	113040	星宇转债	708,350.00	0.11
23	113508	新风转债	565,971.60	0.08
24	110059	浦发转债	4,097.20	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	714	903,096.15	614,727,479.73	95.33%	30,083,172.18	4.67%
新华安享惠金定期债券 C 类	299	17,944.50	100,004.50	1.86%	5,265,400.35	98.14%
合计	1,013	641,832.24	614,827,484.23	94.56%	35,348,572.53	5.44%

### 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	1,879,553,181.54	8,142,932.41
本报告期基金总申购份额	614,876,902.46	53,150.73
减：本报告期基金总赎回份额	1,849,619,432.09	2,830,678.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	644,810,651.91	5,365,404.85

**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**

2021 年 4 月 9 日，翟晨曦女士担任本基金基金管理人董事长职务，张宗友先生担任本基金基金管理人联席董事长职务。

2021 年 5 月 26 日，于春玲女士担任本基金基金管理人总经理职务。

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为进一步维护基金持有人利益，促进会计师事务所提供更优质的服务，2021 年 2 月 1 日本基金会计师事务所由瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）变更为致同会计师事务所（特殊普通合伙）。本次变更事项经本基金管理人董事会审议通过，经基金托管人同意，并已向中国证券监督管理委员会及其派出机构报备。

### 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

本基金管理人本报告期收到重庆证监局出具的行政监管措施，目前已采取措施改进。

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	1,067,728,244.87	100.00%	3,521,500,000.00	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关于调整网上直销汇款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	2021-01-04
2	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基	中国证券报、上海证券	2021-01-05



	金参加平安银行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	报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	
3	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告	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	2021-01-08
4	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在蚂蚁(杭州)基金销售有限公司基金转换补差费公告	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	2021-01-08
5	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台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	2021-01-08
6	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在恒泰证券股份有限公司定期定额投资业务起点金额的公告	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	2021-01-16
7	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年第 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	2021-01-21
8	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-01-21
9	新华基金管理股份有限公司基金改聘会计师事务所公告	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	2021-02-03
10	新华基金管理股份有限公司新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2021-02-03
11	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)	公司网站、电子信披网站	2021-02-04
12	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金(新华安享惠金定期债券 A 类)基金产品资料概要	公司网站、电子信披网站	2021-02-04
13	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金(新华安享惠金定期债券 C 类)基金产品资料概要	公司网站、电子信披网站	2021-02-04
14	新华基金管理股份有限公司新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2021-02-20
15	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)	公司网站、电子信披网站	2021-02-23
16	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金(新华安享惠金定期债券 A 类)基金产品资料概要(更新)	公司网站、电子信披网站	2021-02-23
17	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金(新华安享惠金定期债券 C 类)基金产品资料概要(更新)	公司网站、电子信披网站	2021-02-23

18	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在天风证券股份有限公司定期定额投资业务起点金额的公告	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	2021-02-26
19	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金分红公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2021-03-18
20	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年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	2021-03-30
21	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2021-03-30
22	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	2021-04-10
23	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业务公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2021-04-16
24	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿保险股份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	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	2021-04-16
25	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 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	2021-04-21
26	新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-04-21
27	新华基金管理股份有限公司关于新华安享惠金定期开放债券基金增加销售机构的公告	上海证券报、公司网站、电子信披网站	2021-04-23
28	新华基金管理股份有限公司关于法定代表人变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2021-05-08
29	新华基金管理股份有限公司增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、基金转换业务及参与费率优惠的公告	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	2021-05-14
30	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在北京恒天明泽基金销售有限公司开展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	2021-05-20
31	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、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-05-27
32	新华基金管理股份有限公司关于根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》修订旗下部分公募基金基金合同的公告	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	2021-06-11
33	新华基金管理股份有限公司关于在北京植信基金销售有限公司开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	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	2021-06-26
34	新华基金管理股份有限公司参加中国人寿保	中国证券报、上海证券	2021-06-30

	险股份有限公司费率优惠的公告	报、证券时报、证券日报、 公司网站、电子信披网站	
--	----------------	-----------------------------	--

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210514	825,768,427.08	-	825,768,427.08	0.00	0.00%
	2	20210426-20210513	300,074,268.57	-	300,074,268.57	0.00	0.00%
	3	20210513-20210630	-	487,581,187.91	-	487,581,187.91	74.99%
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

二〇二一年八月二十七日