

# 新华安享惠金定期开放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：广发银行股份有限公司

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。

基金托管人广发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	新华安享惠金定期债券
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	516,841,616.57 份
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。	
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	
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	511,818,580.00 份	5,023,036.57 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)	
	新华安享惠金定期债券 A 类	新华安享惠金定期债券 C 类
	1.本期已实现收益	-2,175,266.01
2.本期利润	7,821,899.48	67,006.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0133	0.0127
4.期末基金资产净值	513,475,499.50	5,021,430.90
5.期末基金份额净值	1.0032	0.9997

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、新华安享惠金定期债券 A 类：

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	1.38%	0.17%	0.68%	0.00%	0.70%	0.17%
过去六个月	-3.27%	0.26%	1.35%	0.00%	-4.62%	0.26%
过去一年	-0.86%	0.21%	2.74%	0.00%	-3.60%	0.21%
过去三年	6.06%	0.13%	8.44%	0.00%	-2.38%	0.13%
过去五年	16.00%	0.11%	14.46%	0.00%	1.54%	0.11%
自基金合同 生效起至今	77.02%	0.14%	29.18%	0.00%	47.84%	0.14%

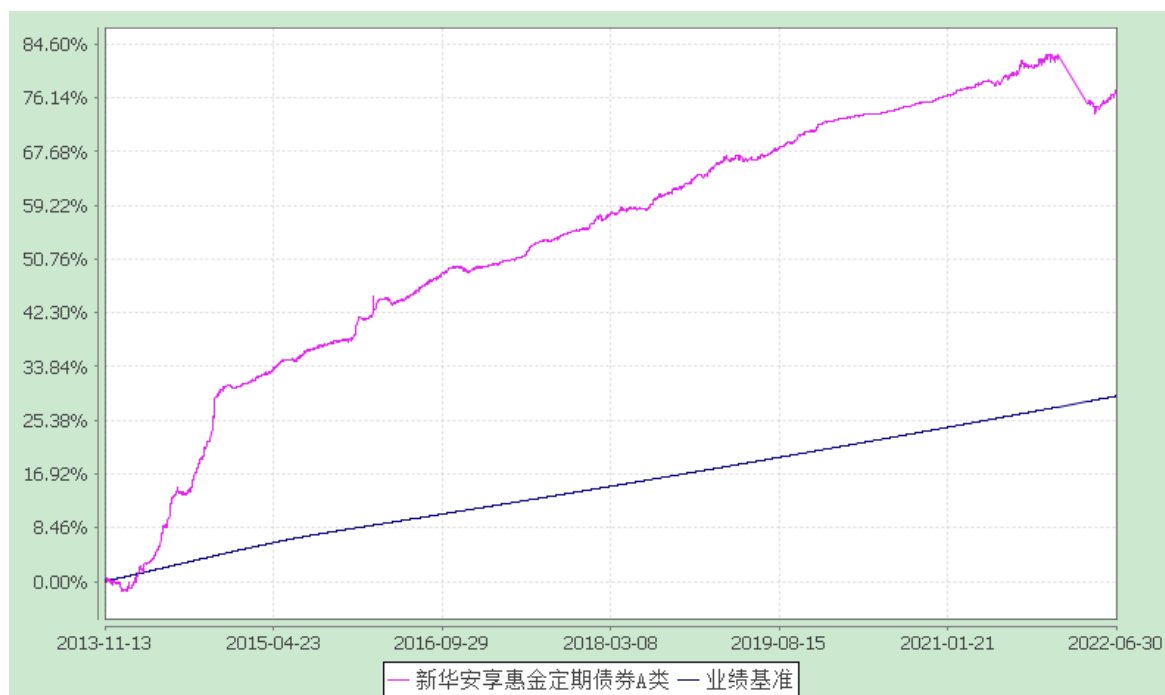
## 2、新华安享惠金定期债券 C 类：

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	1.31%	0.17%	0.68%	0.00%	0.63%	0.17%
过去六个月	-3.43%	0.26%	1.35%	0.00%	-4.78%	0.26%
过去一年	-1.20%	0.21%	2.74%	0.00%	-3.94%	0.21%
过去三年	4.90%	0.13%	8.44%	0.00%	-3.54%	0.13%
过去五年	14.00%	0.11%	14.46%	0.00%	-0.46%	0.11%
自基金合同 生效起至今	71.53%	0.14%	29.18%	0.00%	42.35%	0.14%

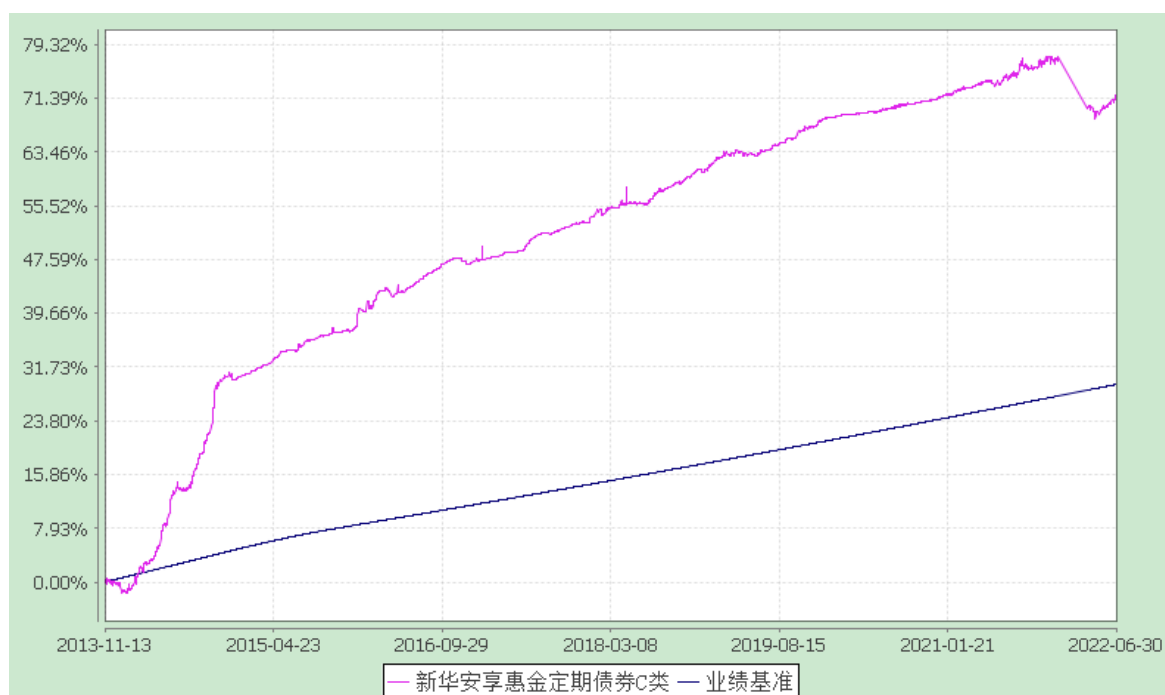
## 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华安享惠金定期开放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  
(2013 年 11 月 13 日至 2022 年 6 月 30 日)

## 1. 新华安享惠金定期债券 A 类：



2. 新华安享惠金定期债券 C 类:



注：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、新华丰利债券型证券投资基金基金经理。	2016-06-01	-	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。
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	2021-02-02	2022-06-23	15	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。

	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、新 华中债 1-5 年 农发行 债券指 数证券 投资基 金基金 经理。				
--	---	--	--	--	--

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 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》，以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。

本基金二季度进入新的运作期，转债部分维持上季度持仓，纯债部分逐步建仓中，以中短久期中高等级信用债为主。

#### 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 1.0032 元，本报告期份额净值增长率为 1.38%，同期比较基准的增长率为 0.68%；本基金 C 类份额净值为 0.9997 元，本报告期份额净值增长率为 1.31%，同期比较基准的增长率为 0.68%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-

2	固定收益投资	423,535,269.55	80.98
	其中：债券	423,535,269.55	80.98
	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	88,035,742.03	16.83
	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	7,869,427.88	1.50
7	其他各项资产	3,571,083.21	0.68
8	合计	523,011,522.67	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	17,655,515.61	3.41
5	企业短期融资券	182,448,553.97	35.19

6	中期票据	73,569,607.67	14.19
7	可转债（可交换债）	149,861,592.30	28.90
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	423,535,269.55	81.69

### 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	012280942	22 知识城 SCP002	400,000	40,252,238.90	7.76
2	101755011	17 珠海港 MTN001	300,000	31,826,967.12	6.14
3	012103726	21 伊犁财通 SCP004	300,000	30,682,558.36	5.92
4	012103711	21 佛公用 SCP006	300,000	30,522,238.36	5.89
5	012280834	22 上海石化 SCP002	300,000	30,189,310.68	5.82

### 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

报告期末,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

本报告期末本基金无股指期货投资。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

**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**

本基金合同中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**

本报告期末本基金无国债期货投资。

**5.10.3 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。

**5.11 投资组合报告附注****5.11.1**

“22 上海石化 SCP002”的发行人中国石化上海石油化工股份有限公司，其所属企业接连发生生产安全事故、安全风险加大的情况，2022 年 6 月 20 日，应急管理部联合国务院国资委约谈中石化集团公司主要负责人。

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。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券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 本报告期内，本基金无股票投资。

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	81,491.08
2	应收证券清算款	3,489,592.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	3,571,083.21
---	----	--------------

## 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	25,191,800.22	4.86
2	113052	兴业转债	11,872,917.52	2.29
3	113013	国君转债	9,694,310.70	1.87
4	110053	苏银转债	9,566,881.67	1.85
5	113050	南银转债	5,632,423.70	1.09
6	110081	闻泰转债	5,124,457.82	0.99
7	128136	立讯转债	4,181,144.76	0.81
8	128134	鸿路转债	3,718,822.02	0.72
9	113045	环旭转债	3,713,460.44	0.72
10	113616	韦尔转债	3,255,638.67	0.63
11	113623	凤 21 转债	3,008,012.28	0.58
12	113602	景 20 转债	2,876,621.30	0.55
13	123115	捷捷转债	2,808,445.68	0.54
14	123104	卫宁转债	2,732,356.37	0.53
15	110047	山鹰转债	2,684,097.05	0.52
16	123025	精测转债	2,607,738.70	0.50
17	110079	杭银转债	2,367,837.57	0.46
18	127031	洋丰转债	2,352,977.43	0.45
19	113619	世运转债	2,077,669.13	0.40
20	111001	山玻转债	1,917,768.26	0.37
21	123117	健帆转债	1,834,165.47	0.35
22	123122	富瀚转债	1,709,725.77	0.33
23	113605	大参转债	1,687,276.67	0.33
24	113579	健友转债	1,648,999.05	0.32
25	110056	亨通转债	1,588,941.89	0.31
26	127030	盛虹转债	1,411,903.79	0.27
27	123124	晶瑞转 2	1,383,598.03	0.27
28	113047	旗滨转债	1,330,255.44	0.26
29	110083	苏租转债	1,307,358.35	0.25
30	127046	百润转债	1,306,481.47	0.25
31	123107	温氏转债	1,281,813.69	0.25
32	110061	川投转债	1,088,940.82	0.21
33	128029	太阳转债	1,087,292.46	0.21
34	128017	金禾转债	953,786.56	0.18
35	113044	大秦转债	931,356.02	0.18
36	113051	节能转债	872,002.01	0.17

37	110048	福能转债	866,589.51	0.17
38	127036	三花转债	808,432.51	0.16
39	123119	康泰转 2	693,718.74	0.13
40	113622	杭叉转债	686,743.91	0.13
41	113634	珀莱转债	682,198.60	0.13
42	123121	帝尔转债	664,646.92	0.13
43	127006	敖东转债	501,730.89	0.10
44	123123	江丰转债	377,762.24	0.07
45	113633	科沃转债	316,982.55	0.06

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金无股票投资。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华安享惠金定期债券 A类	新华安享惠金定期债券 C类
本报告期期初基金份额总额	645,558,334.79	5,380,518.46
报告期期间基金总申购份额	5,570.48	20.11
减：报告期期间基金总赎回份额	133,745,325.27	357,502.00
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	511,818,580.00	5,023,036.57

注：本报告期期间总申购额（份）含本期红利再投的份额。

## §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

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。

### 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 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	20220401-20220630	487,581,187.91	-	-	487,581,187.91	94.34%
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。							

### 8.2 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) 更新的《新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- (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

### 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