

# 新华增怡债券型证券投资基金

**2022 年中期报告**

**2022 年 6 月 30 日**

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

## 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 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> .....	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.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
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合规守信情况声明.....	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	21
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> .....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	56
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>56</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>57</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4	基金投资策略的改变 .....	57
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	57
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
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 .....	57
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.9	其他重大事件 .....	59
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>61</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>62</b>
12.1	备查文件目录 .....	62
12.2	存放地点 .....	63
12.3	查阅方式 .....	63

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华增怡债券型证券投资基金		
基金简称	新华增怡债券		
基金主代码	519162		
交易代码	519162		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 12 月 4 日		
基金管理人	新华基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,276,274,383.35 份		
下属分级基金的基金简称	新华增怡债券 A	新华增怡债券 C	新华增怡债券 E
下属分级基金的交易代码	519162	519163	013720
报告期末下属分级基金的份额总额	1,567,403,522.02 份	380,853,022.15 份	328,017,839.18 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并保持较高资产流动性的前提下，通过配置债券等固定收益类金融工具，追求基金资产的长期稳定增值，通过适量投资权益类资产力争获取增强型回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。首先，本基金管理人将采用战略性与战术性相结合的大类资产配置策略，在基金合同规定的投资比例范围内确定各大类资产的配置比例，在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定的绝对收益。另外，本基金通过自下而上的个股精选策略，精选具有持续成长且估值相对合理的股票构建权益类资产投资组合，增加基金的获利能力，以提高整体的收益水平。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	李申
	联系电话	010-68779688	021-60637102
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008198866	021-60637111

传真	010-68779528	021-60635778
注册地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区金融大街25号
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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	400010	100033
法定代表人	翟晨曦	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）		
	新华增怡债券 A	新华增怡债券 C	新华增怡债券 E
本期已实现收益	-10,026,871.91	-933,282.98	-1,378,604.32
本期利润	-30,247,233.83	-1,524,893.99	-3,011,146.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0203	-0.0139	-0.0129
本期加权平均净值利润率	-1.44%	-0.97%	-1.28%
本期基金份额净值增长率	-1.72%	-1.91%	-1.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
	新华增怡债券 A	新华增怡债券 C	新华增怡债券 E
期末可供分配利润	114,620,634.56	31,637,258.62	-896,580.71
期末可供分配基金份额利润	0.0731	0.0831	-0.0027
期末基金资产净值	2,231,244,611.17	548,625,329.26	333,491,647.59
期末基金份额净值	1.4235	1.4405	1.0167
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		

	新华增怡债券 A	新华增怡债券 C	新华增怡债券 E
基金份额累计净值增长率	71.73%	73.60%	1.67%

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）。

4、本基金于 2013 年 12 月 4 日基金合同生效。

### 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

新华增怡债券 A

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	1.33%	0.26%	0.72%	0.10%	0.61%	0.16%
过去三个月	2.09%	0.26%	0.93%	0.14%	1.16%	0.12%
过去六个月	-1.72%	0.29%	-0.51%	0.15%	-1.21%	0.14%
过去一年	7.43%	0.29%	0.28%	0.13%	7.15%	0.16%
过去三年	18.00%	0.25%	5.39%	0.13%	12.61%	0.12%
自基金合同生效起至今	71.73%	0.31%	10.17%	0.16%	61.56%	0.15%

新华增怡债券 C

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	1.29%	0.26%	0.72%	0.10%	0.57%	0.16%
过去三个月	1.98%	0.26%	0.93%	0.14%	1.05%	0.12%
过去六个月	-1.91%	0.29%	-0.51%	0.15%	-1.40%	0.14%
过去一年	7.00%	0.29%	0.28%	0.13%	6.72%	0.16%
过去三年	16.58%	0.25%	5.39%	0.13%	11.19%	0.12%
自基金合同生效起至今	73.60%	0.32%	10.17%	0.16%	63.43%	0.16%

新华增怡债券 E

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	1.30%	0.26%	0.72%	0.10%	0.58%	0.16%

过去三个月	1.98%	0.26%	0.93%	0.14%	1.05%	0.12%
过去六个月	-1.91%	0.29%	-0.51%	0.15%	-1.40%	0.14%
自基金合同生效起至今	1.67%	0.27%	0.18%	0.13%	1.49%	0.14%

注：1、本基金业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、自 2017 年 12 月 18 日起，业绩比较基准由"中债企业债总全价指数收益率×60%+中债国债总全价指数收益率×30%+沪深 300 指数收益率×10%"变更为"中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%"。

### 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

新华增怡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 12 月 4 日至 2022 年 6 月 30 日)

新华增怡债券 A



新华增怡债券 C





新华增怡债券 E



注：1、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。

2、自 2017 年 12 月 18 日起，业绩比较基准由"中债企业债总全价指数收益率×60%+中债国债总全价指数收益率×30%+沪深 300 指数收益率×10%"变更为"中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%"。

## 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 2022 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、新华鑫弘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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王丹	本基金基金经理，新华双利债券型证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理。	2021-02-02	-	12	金融学硕士，历任民生证券高级分析师，平安养老保险股份有限公司研究经理、研究总监、高级投资经理。
于航	本基金基金经理助理，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金经理助理、新华鑫日	2020-06-03	-	7	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>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、新华安享惠金定期开放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、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、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助</p>				
--	---	--	--	--	--

	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、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。				
李晓然	本基金基金经理助理，新华安享惠金定期开放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、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。	2021-03-01	-	9	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。

	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、新华利率债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、新华红利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、新华鑫回报混合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。				
裴铎	本基金基金经	2022-05-1	-	6	国际经济学硕士, 历任广发银行金

	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、	9		融市场部交易员、投资经理。
--	--	---	--	---------------

	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、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。				
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、安享惠金定期开放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	2020-03-04	2022-04-21	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。



	<p>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经理助理、新华活期添利货币市场基金经理助理</p>				
--	---	--	--	--	--

	理、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型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。

#### 4.1.3 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增怡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》、《新华增怡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

2022 年上半年，债市整体震荡，一季度降息带动下，10 年国债由 2.8%下行 12BP 至 2.68%，后受社融超预期及稳增长发力预期下，10 年国债调整至 2.8%左右，二季度上海和东北疫情爆发，疫情影响下 10 年国债大幅下行至 2.69%左右，6 月份后随着上海的疫情缓解和华东区域经济的恢复，叠加大量专项债的发行，利率出现调整，整体来看，利率上半年是区间震荡。权益市场来看，美联储加息、地缘事件、国内疫情等多重利空叠加影响下，权益市场先暴跌后反弹，1-4 月末，万得全 A、沪深 300 和创业板指数分别下跌-22%、-19%和-30%，5 月-6 月出现反弹，但是上半年整体来看，万得全 A、沪深 300 和创业板指数仍然下跌-9.5%、-9.2%和-15.4%，转债来看，在上半年熊市中体现一定防御属性，1-4 月仅下跌-9.6%，上半年整体来看，仅下跌 4.1%。

本产品报告期间债券部分以金融债和高等级信用债作为底仓，上半年在华东疫情尾声中随着债券的上涨逐步缩短了久期，权益和转债来看，3 月份大幅降低了股票和转债仓位，5 月份后随着权益市场的回暖，逐步增加了权益和转债的仓位，股票结构仍然坚持以“景气行业+高股息”的哑铃组合为主，景气行业以半导体、军工、新能源为主，转债部分来看，以“低价转债+自下而上转债”为主，低价转债从中期来看能够稳健增厚产品收益，自下而上转债则为产品提供弹性。

#### 4.4.2 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 1.4235 元，本报告期份额净值增长率为-1.72%，同期比较基准的增长率为-0.51%；本基金 C 类份额净值为 1.4405 元，本报告期份额净值增长率为-1.91%，同期比较基准的增长率为-0.51%；本基金 E 类份额净值为 1.0167 元，本报告期份额净值增长率为-1.91%，同期比较基准的增长率为-0.51%。

#### 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，伴随地产大周期已过，基建只托难举，疫情频发，经济基本面弱，PPI 下行，央行重心倾向于降低实体融资成本，流动性依旧宽裕，缺资产问题仍然比较突出，因此我们认为股票和债券均具备机会，其中权益资产机会更大，权益方向上仍然维持中期观点-看好科技，特别关注硬科技相关的半导体、军工、新能源等产业链，与此同时，下半年也关注两方面机会：一是 PPI 的下行，带来业绩修复的中游制造业；二是猪周期带来的农业股机会。

#### 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

本报告期本基金无利润分配。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 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

本托管人复核审查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。

# 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：新华增怡债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	214,157,724.65	48,463,014.99
结算备付金		9,025,811.01	1,906,068.60
存出保证金		245,106.01	25,237.35
交易性金融资产	6.4.7.2	3,072,165,897.31	1,351,408,369.97
其中：股票投资		471,442,595.68	148,299,896.00
基金投资		-	-
债券投资		2,600,723,301.63	1,203,108,473.97
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	6,700,000.00	85,450,368.18
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		307,155.18	1,770,676.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	10,174,259.42
资产总计		3,302,601,694.16	1,499,197,995.06

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		184,894,749.54	41,358,293.70
应付赎回款		1,235,964.23	401,461.19
应付管理人报酬		1,543,921.89	379,232.88
应付托管费		441,120.55	108,352.26
应付销售服务费		165,112.31	52,594.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		67,180.15	10,663.96
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	892,057.47	354,859.20
负债合计		189,240,106.14	42,665,457.22
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	2,276,274,383.35	1,068,391,955.12
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	837,087,204.67	388,140,582.72
净资产合计		3,113,361,588.02	1,456,532,537.84
负债和净资产总计		3,302,601,694.16	1,499,197,995.06

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.4235 元，基金份额 1,567,403,522.02 份，C 类基金份额净值 1.4405 元，基金份额 380,853,022.15 份，E 类基金份额净值 1.0167 元，基金份额 328,017,839.18 份。

2、本产品自 2021 年 9 月 24 日起增加 E 类基金份额。

## 6.2 利润表

会计主体：新华增怡债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-22,728,185.92</b>	<b>1,606,785.24</b>
1.利息收入		983,487.46	330,154.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	136,422.99	3,671.72
债券利息收入		-	320,130.15

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		847,064.47	6,352.22
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,547,839.37	-1,207,752.17
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-14,859,854.26	-1,552,028.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	12,384,748.08	404,411.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	927,266.81	-60,135.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-22,444,514.70	2,475,614.61
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	280,680.69	8,768.71
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>12,055,087.99</b>	<b>285,717.83</b>
1. 管理人报酬		8,570,228.47	76,881.45
2. 托管费		2,448,636.69	21,966.11
3. 销售服务费		771,944.69	23,886.57
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		111,466.92	10,426.26
其中：卖出回购金融资产支出		111,466.92	10,426.26
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		27,601.29	858.33
8. 其他费用	6.4.7.18	125,209.93	151,699.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-34,783,273.91</b>	<b>1,321,067.41</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-34,783,273.91</b>	<b>1,321,067.41</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-34,783,273.91</b>	<b>1,321,067.41</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华增怡债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益（若有）		
一、上期期末净资产（基金净值）	1,068,391,955.12	-	388,140,582.72	1,456,532,537.84
二、本期期初净资产（基金净值）	1,068,391,955.12	-	388,140,582.72	1,456,532,537.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,207,882,428.23	-	448,946,621.95	1,656,829,050.18
（一）、综合收益总额	-	-	-34,783,273.91	-34,783,273.91
（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）	1,207,882,428.23	-	483,729,895.86	1,691,612,324.09
其中：1.基金申购款	2,064,455,112.78	-	772,402,616.42	2,836,857,729.20
2.基金赎回款	-856,572,684.55	-	-288,672,720.56	-1,145,245,405.11
（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）	2,276,274,383.35	-	837,087,204.67	3,113,361,588.02
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021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）	56,523,564.24	-	13,151,541.07	69,675,105.31
二、本期期初净资产（基金净值）	56,523,564.24	-	13,151,541.07	69,675,105.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	105,318,238.89	-	39,740,769.40	145,059,008.29
（一）、综合收益总额	-	-	-1,321,067.41	-1,321,067.41
（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）	105,318,238.89	-	41,061,836.81	146,380,075.70



其中：1.基金申购款	154,785,010.36	-	52,901,161.93	207,686,172.29
2.基金赎回款	-49,466,771.47	-	-11,839,325.12	-61,306,096.59
(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)	161,841,803.13	-	55,534,445.29	217,376,248.42

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

新华信用增益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]1061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11月11日至2013年11月29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1,154,972,634.76份,有效认购户数为2,187户,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2013]第404A0018号验资报告予以验证。2013年12月4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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

新华增怡债券型证券投资基金由新华信用增益债券型证券投资基金变更注册而来。2017年12月14日,新华信用增益债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会审议通过了《关于新华信用增益债券型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》,同意变更新华信用增益债券型证券投资基金的投资范围、投资策略、投资比例及业绩比较基准等,同时将新华信用增益债券型证券投资基金的名称变更为新华增怡债券型证券投资基金。自2017年12月18日起,《新华信用增益债券型证券投资基金基金合同》失效且《新华增怡债券型证券投资基金基金合同》同时生效。

根据《新华增怡债券型证券投资基金招募说明书》及《新华增怡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,包括国内依法发行上市的债券、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证、资产支持

证券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的相关规定)。

基金的投资组合比例为：本基金是债券型基金，投资于国债、中央银行票据、金融债券、企业债券(含中小企业私募债券)、公司债券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、回购等债券资产占基金资产比例不低于 80%；其中，投资于信用债券的资产占所有非现金基金资产比例不低于 80%；单只中小企业私募债券占基金资产比例不高于 10%。基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金还可投资于一级市场首次公开发行或增发新股、持有可转债转股所得股票、持有分离交易的可转换公司债券所得权证，也可以投资于二级市场股票和权证，但权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%，其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。

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 2022 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、解释及其它有关规定(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》、《新华增怡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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

除 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则外，本基金本报告期采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于

2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。新金融工具准则的执行对本基金的财务状况和经营成果未产生重大影响。

#### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	214,157,724.65
等于：本金	214,153,168.28
加：应计利息	4,556.37
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	214,157,724.65

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	477,857,406.84	-	471,442,595.68	-6,414,811.16
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所		16,502,924.95		
	市场	1,566,552,181.12		1,582,045,478.42	-1,009,627.65
	银行间		15,902,823.21		
	市场	999,377,490.22		1,018,677,823.21	3,397,509.78
	合计	2,565,929,671.34	32,405,748.16	2,600,723,301.63	2,387,882.13
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,043,787,078.18	32,405,748.16	3,072,165,897.31	-4,026,929.03

### 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

报告期末，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 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,700,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

报告期末，本基金未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	827.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	783,051.05
其中：交易所市场	778,030.38
银行间市场	5,020.67
应付利息	-
账户维护费	9,000.00
审计费	39,671.58
证券日报	59,507.37
合计	892,057.47

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 新华增怡债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	751,130,907.85	751,130,907.85
本期申购	1,532,123,521.03	1,532,123,521.03
本期赎回（以“-”号填列）	-715,850,906.86	-715,850,906.86
本期末	1,567,403,522.02	1,567,403,522.02

##### 新华增怡债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	92,118,223.67	92,118,223.67
本期申购	307,005,686.93	307,005,686.93
本期赎回（以“-”号填列）	-18,270,888.45	-18,270,888.45
本期末	380,853,022.15	380,853,022.15

##### 新华增怡债券 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	225,142,823.60	225,142,823.60
本期申购	225,325,904.82	225,325,904.82
本期赎回（以“-”号填列）	-122,450,889.24	-122,450,889.24
本期末	328,017,839.18	328,017,839.18

注：申购含红利再投资、转换转入份额，赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

新华增怡债券 A

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	59,763,780.86	277,007,173.19	336,770,954.05
本期利润	-10,026,871.91	-20,220,361.92	-30,247,233.83
本期基金份额交易产生的变动数	64,883,725.61	292,433,643.32	357,317,368.93
其中：基金申购款	117,158,752.09	519,810,494.64	636,969,246.73
基金赎回款	-52,275,026.48	-227,376,851.32	-279,651,877.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	114,620,634.56	549,220,454.59	663,841,089.15

新华增怡债券 C

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	8,509,136.29	34,646,527.76	43,155,664.05
本期利润	-933,282.98	-591,611.01	-1,524,893.99
本期基金份额交易产生的变动数	24,061,405.31	102,080,131.74	126,141,537.05
其中：基金申购款	25,677,286.81	108,395,550.61	134,072,837.42
基金赎回款	-1,615,881.50	-6,315,418.87	-7,931,300.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,637,258.62	136,135,048.49	167,772,307.11

新华增怡债券 E

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	875,736.12	7,338,228.50	8,213,964.62
本期利润	-1,378,604.32	-1,632,541.77	-3,011,146.09
本期基金份额交易产生的	-393,712.51	664,702.39	270,989.88

变动数			
其中：基金申购款	-503,769.68	1,864,301.95	1,360,532.27
基金赎回款	110,057.17	-1,199,599.56	-1,089,542.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-896,580.71	6,370,389.12	5,473,808.41

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	61,525.73
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	74,897.26
其他	-
合计	136,422.99

注：结算备付金利息收入中包含结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	250,418,238.44
减：卖出股票成本总额	264,319,974.62
减：交易费用	958,118.08
买卖股票差价收入	-14,859,854.26

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	26,501,251.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-14,116,503.65
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	12,384,748.08



**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,620,486,256.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,618,832,407.23
减：应计利息总额	15,747,283.77
减：交易费用	23,069.35
买卖债券差价收入	-14,116,503.65

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益****6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本报告期，本基金无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	927,266.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	927,266.81

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-22,444,514.70
——股票投资	-10,600,121.74
——债券投资	-11,844,392.96

——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	-22,444,514.70

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	217,762.17
补差费收入	62,918.52
合计	280,680.69

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	7,430.98
账户维护费	18,600.00
查询费	-
证券日报	59,507.37
合计	125,209.93

### 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

截至资产负债表日，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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成 交总额的比例
恒泰证券股份有限 公司	6,162,408.93	0.76%	2,095,116.00	8.28%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间，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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	98,787,666.50	3.42%	1,560,372.65	2.33%

**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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	600,500,000.00	6.17%	-	-

注：上年度可比期间，无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	4,507.09	0.71%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
恒泰证券股份有限公司	1,532.18	8.10%	1,532.18	2.02%

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、上述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	8,570,228.47
其中：支付销售机构的客户维护费	426,886.93	26,233.67

注：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。

本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

#### 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
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,448,636.69	21,966.11

注：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。

#### 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				
	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				
新华增怡债券 A	新华增怡债券 C	新华增怡债券 E	合计		
中国建设银行股份有限公司	-	11,661.79	-	11,661.79	
新华基金管理股份有限公司	-	48,289.92	439,226.66	487,516.58	
恒泰证券股份有限公司	-	1,239.12	-	1,239.12	
合计	-	61,190.83	439,226.66	500,417.49	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间				
	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				
新华增怡债券 A	新华增怡债券 C	新华增怡债券 E	合计		
恒泰证券股份有限公司	-	5.48	-	5.48	
新华基金管理股份有限公司	-	2,674.44	-	2,674.44	
中国建设银行股份有限公司	-	6,011.57	-	6,011.57	
合计	-	8,691.49	-	8,691.49	

注：注：本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4%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×0.4%/当年天数。

本报告期列示的应支付的销售服务费为当期计提金额。

### 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

本报告期及上年度可比期间，本基金与关联方未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

报告期内无转融通出借业务。

#### 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

报告期内无转融通出借业务。

### 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固有资金投资本基金的情况

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。

#### 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

新华增怡债券 C

份额单位：份

关联方名称	新华增怡债券C本期末 2022年6月30日		新华增怡债券C上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
恒泰证券股份有限公司深圳分公司	7,300,000.00	1.92%	7,300,000.00	7.92%

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国建设银行股份有限公司	214,157,724.65	61,525.73	75,317,911.34	2,800.28

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间，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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期，本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022 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

报告期末，本基金未持有因认购新发/增发流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

报告期末，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

报告期末，本基金未持有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

报告期末，本基金未持有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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
A-1	70,073,862.47	-
A-1 以下	-	-
未评级	170,146,622.75	101,002,859.90
合计	240,220,485.22	101,002,859.90

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，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

本报告期末及上年度末，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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	1,799,465,320.98	643,598,038.87
AAA 以下	307,738,730.31	173,320,575.20
未评级	233,746,279.59	285,187,000.00
合计	2,340,950,330.88	1,102,105,614.07

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	19,552,485.53	-



AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	19,552,485.53	-

注：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 2022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	214,157,724.65	-	-	-	214,157,724.65
结算备付金	9,025,811.01	-	-	-	9,025,811.01
存出保证金	245,106.01	-	-	-	245,106.01
交易性金融资产	444,072,106.09	1,729,263,958.13	427,387,237.41	471,442,595.68	3,072,165,897.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,700,000.00	-	-	-	6,700,000.00
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	-	-	-	307,155.18	307,155.18
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	674,200,747.76	1,729,263,958.13	427,387,237.41	471,749,750.86	3,302,601,694.16
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	-	-	-	184,894,749.54	184,894,749.54
应付赎回款	-	-	-	1,235,964.23	1,235,964.23
应付管理人报酬	-	-	-	1,543,921.89	1,543,921.89
应付托管费	-	-	-	441,120.55	441,120.55
应付销售服务费	-	-	-	165,112.31	165,112.31
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	67,180.15	67,180.15
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	892,057.47	892,057.47
负债总计	-	-	-	189,240,106.14	189,240,106.14

利率敏感度缺口	674,200,747.76	1,729,263,958.13	427,387,237.41	282,509,644.72	3,113,361,588.02
<b>上年度末 2021 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	48,463,014.99	-	-	-	48,463,014.99
结算备付金	1,906,068.60	-	-	-	1,906,068.60
存出保证金	25,237.35	-	-	-	25,237.35
交易性金融资产	101,002,859.90	304,867,396.50	797,238,217.57	148,299,896.00	1,351,408,369.97
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	85,450,368.18	-	-	-	85,450,368.18
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	10,174,259.42	10,174,259.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,770,676.55	1,770,676.55
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	236,847,549.02	304,867,396.50	797,238,217.57	160,244,831.97	1,499,197,995.06
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	-	-	-	41,358,293.70	41,358,293.70
应付赎回款	-	-	-	401,461.19	401,461.19
应付管理人报酬	-	-	-	379,232.88	379,232.88
应付托管费	-	-	-	108,352.26	108,352.26
应付销售服务费	-	-	-	52,594.03	52,594.03
应付交易费用	-	-	-	185,824.82	185,824.82
应交税费	-	-	-	10,663.96	10,663.96
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	169,034.38	169,034.38

负债总计	-	-	-	42,665,457.22	42,665,457.22
利率敏感度缺口	236,847,549.02	304,867,396.50	797,238,217.57	117,579,374.75	1,456,532,537.84

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
		市场利率上升 25.00 bp	-19,153,978.56
市场利率下降 25.00 bp	19,442,252.96	18,420,903.64	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，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股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	471,442,595.	15.14	148,299,896.0	10.18

	68		0	
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,600,723,30	83.53	1,203,108,473	82.60
	1.63		.97	
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	3,072,165,89	98.68	1,351,408,369	92.78
	7.31		.97	

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升或下降 1%		
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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	4,943,144.74	1,302,169.86
	沪深 300 指数下降 1%	-4,943,144.74	-1,302,169.86

#### 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
	2022 年 6 月 30 日
第一层次	1,105,789,295.41
第二层次	1,966,376,601.90

第三层次	0.00
合计	3,072,165,897.31

#### 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 2022 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	471,442,595.68	14.27
	其中：股票	471,442,595.68	14.27

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,600,723,301.63	78.75
	其中：债券	2,600,723,301.63	78.75
	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	6,700,000.00	0.20
	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	223,183,535.66	6.76
8	其他各项资产	552,261.19	0.02
9	合计	3,302,601,694.16	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,322,500.00	0.17
B	采矿业	5,792,760.00	0.19
C	制造业	349,418,452.38	11.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,936,000.00	0.22
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	25,042,000.00	0.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,034,252.50	0.93
J	金融业	49,896,630.80	1.60
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	471,442,595.68	15.14

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末，本基金未持有港股通投资的股票。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002371	北方华创	129,523	35,893,413.76	1.15
2	603986	兆易创新	225,000	31,997,250.00	1.03
3	600941	中国移动	479,905	29,034,252.50	0.93
4	603501	韦尔股份	148,946	25,772,126.38	0.83
5	601006	大秦铁路	3,800,000	25,042,000.00	0.80
6	000333	美的集团	400,000	24,156,000.00	0.78
7	688981	中芯国际	500,000	22,585,000.00	0.73
8	300777	中简科技	450,000	21,690,000.00	0.70
9	002409	雅克科技	385,200	21,382,452.00	0.69
10	601012	隆基绿能	311,903	20,782,096.89	0.67
11	002049	紫光国微	100,000	18,972,000.00	0.61
12	601601	中国太保	800,000	18,824,000.00	0.60
13	688008	澜起科技	280,000	16,962,400.00	0.54
14	603650	彤程新材	520,000	16,941,600.00	0.54
15	600030	中信证券	600,000	12,996,000.00	0.42
16	688303	大全能源	166,300	11,361,616.00	0.36
17	688233	神工股份	200,000	11,240,000.00	0.36
18	300059	东方财富	410,202	10,419,130.80	0.33
19	603486	科沃斯	80,000	9,751,200.00	0.31
20	600438	通威股份	133,600	7,997,296.00	0.26
21	600958	东方证券	750,000	7,657,500.00	0.25
22	601865	福莱特	200,000	7,620,000.00	0.24
23	688082	盛美上海	80,000	7,581,600.00	0.24
24	688037	芯源微	50,000	7,248,500.00	0.23
25	688012	中微公司	60,000	7,005,000.00	0.22
26	600900	长江电力	300,000	6,936,000.00	0.22



27	300498	温氏股份	250,000	5,322,500.00	0.17
28	600765	中航重机	149,920	4,824,425.60	0.15
29	688388	嘉元科技	50,000	4,243,500.00	0.14
30	300223	北京君正	30,000	3,187,500.00	0.10
31	600460	士兰微	60,000	3,120,000.00	0.10
32	601088	中国神华	90,000	2,997,000.00	0.10
33	688167	炬光科技	20,000	2,975,000.00	0.10
34	601225	陕西煤业	132,000	2,795,760.00	0.09
35	300855	图南股份	60,000	2,507,400.00	0.08
36	688599	天合光能	9,523	621,375.75	0.02
37	300438	鹏辉能源	10,000	614,500.00	0.02
38	300775	三角防务	8,000	385,200.00	0.01

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600941	中国移动	54,354,357.46	3.73
2	300059	东方财富	38,420,694.96	2.64
3	601006	大秦铁路	35,414,138.90	2.43
4	603986	兆易创新	30,131,247.28	2.07
5	002371	北方华创	25,761,788.60	1.77
6	002409	雅克科技	23,723,177.00	1.63
7	000333	美的集团	23,537,627.94	1.62
8	688981	中芯国际	22,768,136.18	1.56
9	300777	中简科技	22,524,281.00	1.55
10	603501	韦尔股份	19,601,773.18	1.35
11	601601	中国太保	18,660,487.66	1.28
12	002049	紫光国微	18,542,399.80	1.27
13	603650	彤程新材	17,978,223.00	1.23
14	600038	中直股份	17,847,829.00	1.23
15	600900	长江电力	17,662,978.00	1.21
16	688008	澜起科技	16,557,935.52	1.14
17	300782	卓胜微	15,410,126.36	1.06
18	601012	隆基绿能	13,769,896.19	0.95
19	600958	东方证券	13,752,323.00	0.94
20	600030	中信证券	13,098,021.35	0.90

注：本项“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

##### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	27,363,571.16	1.88
2	600941	中国移动	26,779,835.00	1.84
3	601006	大秦铁路	20,350,159.00	1.40
4	600038	中直股份	15,161,616.00	1.04
5	300782	卓胜微	14,591,267.40	1.00
6	603986	兆易创新	13,640,381.00	0.94
7	601225	陕西煤业	12,545,325.00	0.86
8	600900	长江电力	11,614,342.00	0.80
9	300438	鹏辉能源	9,777,408.00	0.67
10	600958	东方证券	9,769,142.00	0.67
11	600438	通威股份	8,494,483.00	0.58
12	300775	三角防务	8,272,002.00	0.57
13	603859	能科科技	7,373,523.00	0.51
14	002013	中航机电	6,742,708.00	0.46
15	000776	广发证券	6,510,368.00	0.45
16	600760	中航沈飞	5,608,575.00	0.39
17	002409	雅克科技	5,431,354.00	0.37
18	300498	温氏股份	5,289,262.64	0.36
19	600507	方大特钢	4,721,771.00	0.32
20	688002	睿创微纳	4,371,959.93	0.30

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	598,062,796.04
卖出股票的收入（成交）总额	250,418,238.44

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

#### 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	170,146,622.75	5.47
2	央行票据	-	-

3	金融债券	907,035,987.00	29.13
	其中：政策性金融债	233,746,279.59	7.51
4	企业债券	727,357,739.49	23.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	142,283,767.13	4.57
7	可转债（可交换债）	634,346,699.73	20.37
8	同业存单	19,552,485.53	0.63
9	其他	-	-
10	合计	2,600,723,301.63	83.53

#### 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	210316	21 进出 16	1,900,000	198,995,328.77	6.39
2	019664	21 国债 16	1,673,910	170,146,622.75	5.47
3	2120110	21 北京银行永续债 02	1,000,000	103,083,287.67	3.31
4	2128047	21 招商银行永续债	1,000,000	102,676,060.27	3.30
5	2228001	22 邮储银行永续债 01	900,000	91,137,333.70	2.93

#### 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

报告期末，本基金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

报告期末，本基金未持有贵金属。

#### 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

报告期末，本基金未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

## 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 投资组合报告附注

### 7.12.1

1、“韦尔股份”发行人上海韦尔半导体股份有限公司，因资产质押情况未及时在临时公告中披露，上海监管局对其采取出具警示函的监管措施。（《关于上海韦尔半导体股份有限公司采取出具警示函措施的决定》，沪证监决〔2021〕67号，2021年4月28日）

2、“21 进出 16”发行人中国进出口银行：

（1）因漏报不良贷款余额 EAST 数据等 17 项违规，被罚款 420 万元。（【银保监罚决字（2022）9 号】，2022 年 3 月 21 日）

（2）因违规投资企业股权、租金保理业务基础交易不真实、反国家压降地方债务的政策要求，变相支持地方政府举债等 24 项违法违规行为，银保监会依法对其罚没 7345.6 万元。（银保监罚决字（2021）31 号，2021 年 7 月 31 日）

（3）2021 年 11 月，中国进出口银行因执行内部收费减免要求不到位，被银保监会消费者权益保护局列为典型案例并进行通报。

3、“21 北京银行永续债 02”发行人北京银行股份有限公司：

（1）因发生重要信息系统突发事件但未向监管部门报告，严重违反审慎经营规则，中国银保监会北京监管局对其处以罚款 40 万元。（京银保监罚决字（2021）30 号，2021 年 11 月 24 日）

（2）因服务收费管理不力，违规收费；理财和同业投资业务严重违反审慎经营规则；贷款管理不到位导致贷款资金被挪用，中国银保监会北京监管局对其处以责令改正，并给予合计 820 万元罚款的行政处罚。（京银保监罚决字（2021）26 号，2021 年 9 月 26 日）

4、“21 招商银行永续债”发行人招商银行股份有限公司因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送 13 项违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款 300 万元。（银保监罚决字（2022）21 号，2022 年 3 月 21 日）

## 5、“22 邮储银行永续债 01”的发行人邮政储蓄银行：

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

(2) 利用市场优势地位转嫁抵押评估费，因违规及不当收费问题被点名。

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

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

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

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

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。

7.12.2 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。

## 7.12.3 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	245,106.01
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	307,155.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	552,261.19

## 7.12.4 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	110081	闻泰转债	88,532,399.87	2.84
2	113042	上银转债	83,639,928.99	2.69
3	132018	G 三峡 EB1	56,090,753.89	1.80
4	110059	浦发转债	46,064,944.22	1.48
5	113013	国君转债	31,686,559.95	1.02
6	127016	鲁泰转债	29,362,036.69	0.94
7	113044	大秦转债	28,921,112.82	0.93
8	127018	本钢转债	25,959,246.57	0.83
9	113616	韦尔转债	22,913,361.21	0.74
10	123107	温氏转债	21,268,155.29	0.68
11	127040	国泰转债	18,727,967.15	0.60
12	128035	大族转债	12,635,671.23	0.41
13	123115	捷捷转债	12,200,024.66	0.39
14	113048	晶科转债	10,223,649.32	0.33
15	123077	汉得转债	10,218,399.88	0.33
16	113530	大丰转债	7,955,021.92	0.26
17	123123	江丰转债	7,656,629.61	0.25
18	128136	立讯转债	6,069,008.84	0.19
19	113049	长汽转债	5,783,730.08	0.19
20	118000	嘉元转债	5,627,133.15	0.18
21	127027	靖远转债	4,433,908.77	0.14
22	110075	南航转债	4,195,112.05	0.13
23	118003	华兴转债	3,821,104.51	0.12
24	110068	龙净转债	3,758,635.62	0.12
25	110056	亨通转债	3,695,213.70	0.12
26	113615	金诚转债	3,436,797.26	0.11
27	118001	金博转债	2,750,517.81	0.09
28	123025	精测转债	2,441,422.36	0.08
29	110076	华海转债	2,278,282.19	0.07
30	110067	华安转债	2,258,197.44	0.07
31	123083	朗新转债	1,963,943.65	0.06
32	127026	超声转债	1,632,885.21	0.05
33	113043	财通转债	1,551,591.62	0.05
34	113046	金田转债	1,467,448.90	0.05
35	127037	银轮转债	1,374,963.01	0.04
36	113633	科沃转债	1,187,200.55	0.04
37	127024	盈峰转债	1,077,919.18	0.03
38	127041	弘亚转债	801,453.36	0.03

39	128137	洁美转债	669,521.51	0.02
40	128142	新乳转债	571,718.49	0.02

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 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
新华增怡债券 A	2,788	562,196.39	1,542,561,293.00	98.42%	24,842,229.02	1.58%
新华增怡债券 C	2,305	165,229.08	364,581,724.14	95.73%	16,271,298.01	4.27%
新华增怡债券 E	1,729	189,715.35	322,808,627.87	98.41%	5,209,211.31	1.59%
合计	6,822	333,666.72	2,229,951,645.01	97.96%	46,322,738.34	2.04%

#### 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	新华增怡债券 A	671,532.84	0.04%

	新华增怡债券 C	61,520.88	0.02%
	新华增怡债券 E	61,630.84	0.02%
	合计	794,684.56	0.03%

### 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	新华增怡债券 A	10~50
	新华增怡债券 C	0~10
	新华增怡债券 E	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	新华增怡债券 A	10~50
	新华增怡债券 C	0
	新华增怡债券 E	0
	合计	10~50

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 10~50 万份；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 10~50 万份。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华增怡债券 A	新华增怡债券 C	新华增怡债券 E
基金合同生效日（2013 年 12 月 4 日）基金份额总额	253,515,369.44	901,457,265.32	-
本报告期期初基金份额总额	751,130,907.85	92,118,223.67	225,142,823.60
本报告期基金总申购份额	1,532,123,521.03	307,005,686.93	225,325,904.82
减：本报告期基金总赎回份额	715,850,906.86	18,270,888.45	122,450,889.24
本报告期基金拆分变	-	-	-



动份额			
本报告期末基金份额总额	1,567,403,522.02	380,853,022.15	328,017,839.18

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

本报告期基金管理人、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

本报告期末未有基金投资策略的改变。

### 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

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

### 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	
华安证券	2	352,110,609.99	43.18%	257,496.89	40.31%	-
太平洋证券	2	203,109,715.47	24.91%	148,534.56	23.25%	-
国信证券	1	141,733,868.50	17.38%	131,997.41	20.67%	-
银河证券	1	70,189,860.18	8.61%	65,367.74	10.23%	-
安信证券	2	42,160,169.91	5.17%	30,830.99	4.83%	-
恒泰证券	2	6,162,408.93	0.76%	4,507.09	0.71%	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

方正证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-

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》（证监基金字[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 22 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
华安证券	1,384,720,012.98	47.86%	3,197,800,000.00	32.84%	-	-
太平洋证券	111,745,053.29	3.86%	4,295,120,000.00	44.11%	-	-
国信证券	590,723,860.46	20.42%	1,172,900,000.00	12.05%	-	-
银河证券	61,220,143.90	2.12%	52,500,000.00	0.54%	-	-
安信证券	53,556,654.30	1.85%	417,900,000.00	4.29%	-	-
恒泰证券	98,787,666.50	3.41%	600,500,000.00	6.17%	-	-
申银万国	562,238,845.89	19.43%	-	-	-	-
国金证券	30,495,817.81	1.05%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

## 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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-04
2	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海万得基金销售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	2022-01-11

3	新华基金管理股份有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-01-13
4	新华基金管理股份有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-01-13
5	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 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	2022-01-21
6	新华增怡债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-01-21
7	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售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	2022-02-15
8	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任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	2022-02-24
9	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在北京汇成基金销售有限公司开通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	2022-02-25
10	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行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	2022-02-25
11	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理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	2022-03-07
12	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分公募基金增加销售机构、参加费率优惠活动并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	2022-03-12
13	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券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	2022-03-18
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换业务及参加网上费率优惠活动的公告	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	2022-03-28
16	新华增怡债券型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2022-03-30
15	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 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	2022-03-30

17	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海利得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	2022-04-15
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加五矿证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	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	2022-04-20
20	新华增怡债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-04-21
19	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 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	2022-04-21
21	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加招商银行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	2022-04-26
22	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增加国泰君安证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-28
23	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在中国建设银行股份有限公司开通定期定额投资业务并修改定期定额投资业务起点金额的公告	上海证券报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-06-06
24	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海攀赢基金销售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	2022-06-09
25	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增加英大证券有限责任公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	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	2022-06-22

## 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	20220307-20220623	104,072,018.32	716,488,075.03	410,634,541.78	409,925,551.57	18.01%
产品特有风险							
1、根据本基金投资范围的规定，本基金投资于债券的资产占基金资产比例不低于80%。因此，本基							

金需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及发债主体特别是公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险，以及无法偿债造成的信用违约风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险。

2、本基金投资于可转换债券品种，可转换债券的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，对这些条款研究不足导致的事件可能为本基金带来损失。例如，当可转换债券的价格明显高于其赎回价格时，若本基金未能在可转换债券被赎回前转股或卖出，则可能产生不必要的损失。

3、本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券的投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

4、本基金投资流通受限证券，可能面临流动性风险、法律风险、道德风险和操作风险。基金管理人将制订严格的投资决策流程和风险控制制度，根据基金管理人净资本规模，以及基金的投资风格和流动性特点，兼顾基金投资的安全性、流动性和收益性，合理控制基金投资流通受限证券的比例。

5、本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有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信用增益债券型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华信用增益债券型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华增怡债券型证券投资基金托管协议
- (四) 新华增怡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) 《新华增怡债券型证券投资基金招募说明书》（更新）
- (七) 《新华增怡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

二〇二二年八月三十日