

新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金
2020 年中期报告
2020 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十七日

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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 年 3 月 12 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	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
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.11 投资组合报告附注.....	44
8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
9 开放式基金份额变动	46
10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误!未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变	错误!未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误!未定义书签。
10.8 其他重大事件	48
11 影响投资者决策的其他重要信息	49
12 备查文件目录	错误!未定义书签。
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券	
基金主代码	004567	
交易代码	004567	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 12 日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,700,054,193.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华安享惠泽 39 个月定期 开放债券 A	新华安享惠泽 39 个月定 期开放债券 C
下属分级基金的交易代码	004567	008808
报告期末下属分级基金的份额总额	2,700,047,593.40 份	6,600.08 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用持有到期策略，在追求基金资产安全、保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	<p>在封闭期，本基金采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。</p> <p>在开放期，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
业绩比较基准	在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+1.5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公

			司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	田东辉
	联系电话	010-68779688	010-68858113
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		4008198866	95580
传真		010-68779528	010-68858120
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3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	北京市西城区金融大街3号
邮政编码		400010	100808
法定代表人		张宗友	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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(2020年3月12日(基金合同生效日)至2020年6月30日)	
	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 A	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 C
本期已实现收益	11,951,779.09	20.41
本期利润	11,951,779.09	20.41
加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0031
本期加权平均净值利润率	0.45%	0.31%
本期基金份额净值增长率	0.44%	0.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
	新华安享惠泽 39 个月定期	新华安享惠泽 39 个月定期

	开放债券 A	开放债券 C
期末可供分配利润	11,951,779.09	20.41
期末可供分配基金份额利润	0.0044	0.0031
期末基金资产净值	2,711,999,372.49	6,620.49
期末基金份额净值	1.0044	1.0031
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 A	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 C
基金份额累计净值增长率	0.44%	0.31%

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，由于本基金采用摊余成本法核算，所以公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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、本基金合同于 2020 年 3 月 12 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

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

新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 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	0.16%	0.01%	0.37%	0.01%	-0.21%	0.00%
过去三个月	0.39%	0.01%	1.05%	0.01%	-0.66%	0.00%
成立至今	0.44%	0.01%	1.29%	0.01%	-0.85%	0.00%

新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 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	0.12%	0.01%	0.37%	0.01%	-0.25%	0.00%
过去三个月	0.28%	0.01%	1.05%	0.01%	-0.77%	0.00%
成立至今	0.31%	0.01%	1.29%	0.01%	-0.98%	0.00%

注：1、本基金的业绩比较基准为：封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+1.5%。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、本基金合同于 2020 年 3 月 12 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

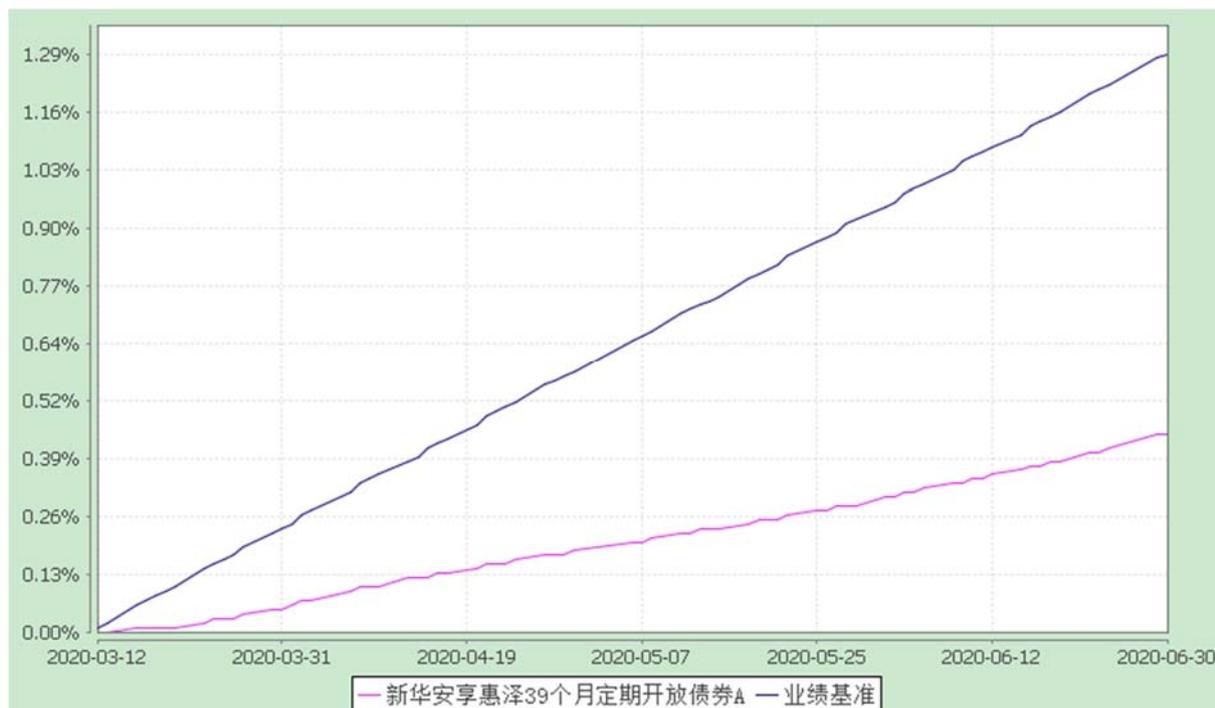
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金

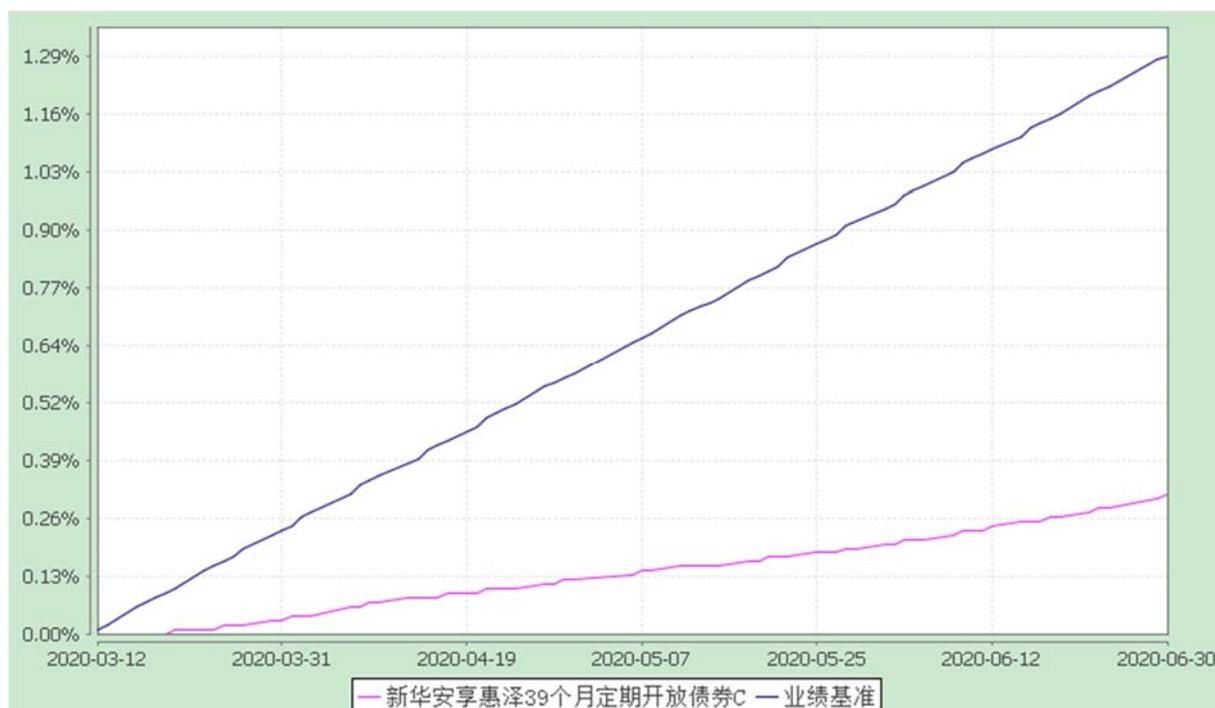
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 3 月 12 日至 2020 年 6 月 30 日)

新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 A



新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 C



- 注：1、报告期内本基金各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定；
- 2、本基金合同于 2020 年 3 月 12 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

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 2020 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十五只开放式基金，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分级证券投资基金、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 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）。

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		
王滨	本基金基金经理，固定收益与平衡投资部总监、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理、新华鑫日享中短债债券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、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华增强债券型证券投资基金基金经理。	2020-03-12	-	13	管理学硕士，历任中国工商银行总行固定收益投资经理、中国民生银行投资经理、民生加银基金管理有限公司基金经理、新华基金管理股份有限公司投资经理。
李洁	本基金基金经理，新华活期添利货币市场基金基金经理、新华增强债券型证券投资基金基金经理。	2020-05-12	-	6	经济学硕士，历任中债信用业务经理、高级经理，新华基金固定收益与平衡投资部债券研究员、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、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理。	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。

	<p>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</p>				
--	--	--	--	--	--

	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、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	2020-06-03	-	5	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、转债研究等工作。

	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。				
--	--	--	--	--	--

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泽 39 个月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》、《新华安享惠泽 39 个月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

疫情是影响 2020 年上半年债券市场的核心主线：今年前四个月，突发的新冠疫情使得宏观经济几近停滞，其强度和持续性都超出市场预期，供需方面对经济形成重挫。为对冲疫情对经济的负面影响，全球央行推动流动性宽松政策，国内债券收益率下探至近十年地位，1 年期和 10 年期国开债分别较年初下行 134bp 和 80bp 至 1.19%和 2.79%。五月开始，尽管疫情并未完全控制，但是随着主要国家复工复产持续推进，国内宏观经济渐进修复，货币政策相应地由应对疫情的危机模式向常态化模式转变。在财政政策发力、各项经济数据逐步好转、流动性宽松边际放缓、债券供给冲击到来等因素共同作用下，资金面有所收紧，债市持续大幅调整，1 年期和 10 年期国开债从 4 月底低点分别回调了 99bp、30bp 至 2.19%和 3.10%。

本报告期内，本基金秉持稳健投资原则谨慎操作，在疫情冲击导致收益率快速下行阶段，资产配置以逆回购、存款为主，待收益率调整至具备配置价值区间后，完成了建仓工作并适度使用杠杆，主要投资品种以到期日贴近下一开放日的政策金融债及商业银行金融债为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0044 元，本报告期份额净值增长率为 0.44%，

同期比较基准增长率为 1.29%；本基金 C 类份额净值为 1.0031 元，本报告期份额净值增长率为 0.31%，比较基准增长率为 1.29%。

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 2020 年下半年，国内疫情防控向常态化转型背景下，基本面逐渐改善是大概率事件，政策重心由宽货币向宽信用的转变过程中，流动性合理充裕格局有望保持，但是资金面最宽松阶段已过。市场预期会发生相应调整，债市收益率也会经历从低点修复的过程。虽然短期内经济再失速的风险较低，但是中期来看，经济在向上恢复之后的增长中枢可能有所下降，这取决于疫情对相关行业增速的影响。基本面修复和货币政策进入观察期，债市可能会处于震荡调整阶段，基本面逐步好转、货币政策回归常态、供给压力等对债券走势不利，但中美利差及中长期经济增长动能不足问题仍然是债市支撑。

本基金在投资策略上将继续遵循稳健投资理念，主要配置利率及高等级商业银行金融债，以持有至到期获取稳定票息收入为主，继续使用杠杆策略同时严格控制融资成本，以增强组合收益，为持有人获取更好的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.7.1.1 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、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。

4.7.1.2 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。

4.7.1.3 投资管理部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询；
- 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。

4.7.1.4 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。

4.7.1.5 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部问询；
- 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

本基金合同于 2020 年 3 月 12 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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（如有）、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：新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	14,224,962.91
结算备付金		38,388,888.89
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,060,196,425.94
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		3,060,196,425.94
资产支持证券投资		-
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	17,877,124.11
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		3,130,687,401.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
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		418,127,430.93
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		333,173.17
应付托管费		111,057.75
应付销售服务费		2.40
应付交易费用	6.4.7.7	19,037.23
应交税费		-
应付利息		24,211.73
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	66,495.66
负债合计		418,681,408.87
所有者权益：		-
实收基金	6.4.7.9	2,700,054,193.48

未分配利润	6.4.7.10	11,951,799.50
所有者权益合计		2,712,005,992.98
负债和所有者权益总计		3,130,687,401.85

注：本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。截至 2020 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0044 元，基金份额 2,700,047,593.40 份，本基金 C 类份额净值为 1.0031 元，基金份额 6,600.08 份。

6.2 利润表

会计主体：新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2020 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		13,669,149.59
1.利息收入		13,669,149.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,479,907.50
债券利息收入		1,076,635.13
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		11,112,606.96
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-
股利收益	6.4.7.18	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-
减：二、费用		1,717,350.09
1. 管理人报酬		1,219,675.41
2. 托管费		406,558.49
3. 销售服务费		8.80
4. 交易费用	6.4.7.21	-
5. 利息支出		24,211.73

其中：卖出回购金融资产支出		24,211.73
6.税金及附加		-
7.其他费用	6.4.7.22	66,895.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,951,799.50
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,951,799.50

注：本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 12 日（基金合同生效日）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）	2,700,054,193.48	-	2,700,054,193.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,951,799.50	11,951,799.50
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,700,054,193.48	11,951,799.50	2,712,005,992.98

注：本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

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：张宗友，主管会计工作负责人：刘全胜，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

新华安享惠泽 39 个月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[2017]441 号文件准予注册,并经证监许可[2019]2617 号文件准予变更注册后,由新华基金管理股份有限公司发起募集的契约型开放式基金,于 2020 年 1 月 6 日至 2020 年 3 月 6 日向社会公开募集,首次募集资金总额 2,700,054,193.48 元,其中募集资金产生利息 22,000.39 元,并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2020]36010003 号验资报告予以验证。2020 年 3 月 12 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,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码,分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别,但不同基金份额类别之间不得相互转换。

根据《新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及《新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金合同》,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(国债、政府机构债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款)、同业存单、货币市场工具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)。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%,但在每次开放期前 3 个月、开放期及开放期结束后 3 个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。在开放期,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,封闭期内不受上述 5%的限制。如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。在每个封闭期,本基金的业绩比较基准为该封闭期起始

日公布的三年期定期存款利率（税后）+1.5%。

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 2020 年 8 月 26 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编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 42 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市

场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。申购、赎

回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

(2) 投资收益

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

1、本基金管理人报酬按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率逐日计提。

- 2、本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率逐日计提。
- 3、本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40%年费率逐日计提。
- 4、卖出回购金融资产支出，按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。
- 5、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等收益分配权；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内未有其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生差错更正。

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）交易印花税征收方式，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、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》：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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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。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。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	14,224,962.91
定期存款	-
其他存款	-
合计	14,224,962.91

注：本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	-	-
	银行间市场	3,060,196,425.94	3,060,196,425.94
	合计	3,060,196,425.94	3,060,196,425.94
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,060,196,425.94	3,060,196,425.94	-

注：1、本基金估值采用摊余成本法，上述公允价值部分以摊余成本列示。

2、本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本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

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,769.78
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	15,552.13
应收债券利息	17,855,802.20
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	-
合计	17,877,124.11

注：本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产，本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	19,037.23
合计	19,037.23

注：本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	-
其他应付款	-
预提费用	66,495.66
合计	66,495.66

注：本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.7.9 实收基金

新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	2,700,047,593.40	2,700,047,593.40
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,700,047,593.40	2,700,047,593.40

新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	6,600.08	6,600.08
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	6,600.08	6,600.08

注：1、本基金以每个封闭期为周期进行投资运作，封闭期内投资人无法进行基金份额申购与赎回，本基金封闭期为 39 个月。

2、本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.7.10 未分配利润

新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 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
本期利润	11,951,779.09	-	11,951,779.09
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,951,779.09	-	11,951,779.09

新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 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
本期利润	20.41	-	20.41
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20.41	-	20.41

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 12 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	910,019.25
定期存款利息收入	451,500.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	118,388.25
其他	-
合计	1,479,907.50

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益**6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	0.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应收利息总额	-
买卖债券差价收入	-

注：本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.14.2 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.14.3 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 贵金属投资收益**6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

6.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.17 衍生工具收益

6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无其他投资收益。

6.4.7.18 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.19 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动损益。

6.4.7.20 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.21 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

6.4.7.21.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期内未持有基金，无持有基金产生的费用。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	30,102.09
信息披露费	36,393.57
证券出借违约金	-

债券账户维护费	-
汇划手续费	-
其他	400.00
合计	66,895.66

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 2020 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

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 2020年3月12日（基金合同生效日）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
恒泰证券股份有限公司	25,305,400,000.00	100.00%

注：本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

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 2020年3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	7.70

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率每日计算，逐日累计至每月月末，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×0.15%/当年天数。

2、本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：1、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

2、本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

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 2020年3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 A	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 C	合计
新华基金管理股份有限公司	-	5.50	5.50
合计	-	5.50	5.50

注：1、基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.45% 年费率每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

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×0.45%/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

本报告期本基金无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期本基金无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

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

本报告期本基金无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

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 2020年3月12日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
	中国邮政储蓄银行股份有限公司	14,224,962.91

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。本基金于 2020 年 3 月 12 日基金合同生效，截至报告期末 2020 年 6 月 30 日成立未满一年。

6.4.12 期末（2020 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末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

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 418,127,430.93 元，以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
160417	16 农发 17	2020-07-01	101.80	624,000.00	63,521,242.67
200402	20 农发 02	2020-07-01	98.27	2,750,000.00	270,252,844.04
190403	19 农发 03	2020-07-01	100.91	1,050,000.00	105,956,069.03
合计				4,424,000.00	439,730,155.74

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末本基金无交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本报告期末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 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 2020年6月30日
AAA	1,313,589,527.94
AAA 以下	-
未评级	1,746,606,898.00
合计	3,060,196,425.94

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 2020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	14,224,962.91	-	-	-	14,224,962.91
结算备付金	38,388,888.89	-	-	-	38,388,888.89
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	3,060,196,425.94	-	-	3,060,196,425.94
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	17,877,124.11	17,877,124.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	52,613,851.80	3,060,196,425.94	-	17,877,124.11	3,130,687,401.85
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	418,127,430.93	-	-	-	418,127,430.93

产款					3
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	333,173.17	333,173.17
应付托管费	-	-	-	111,057.75	111,057.75
应付销售服务费	-	-	-	2.40	2.40
应付交易费用	-	-	-	19,037.23	19,037.23
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	24,211.73	24,211.73
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	66,495.66	66,495.66
负债总计	418,127,430.93	-	-	553,977.94	418,681,408.87
利率敏感度缺口	-365,513,579.13	3,060,196,425.94	-	17,323,146.17	2,712,005,992.98

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2020 年 6 月 30 日
	市场利率上升 25bp	-19,105,891.99
	市场利率下降 25bp	19,276,045.04

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 2020 年 6 月 30 日	
	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	3,063,320,000.00	112.95
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	3,063,320,000.00	112.95

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，并同时考虑其买入时的溢价和折价，确认利息收入并评估减值准备。本基金本报告期内未计提减值准备。

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	3,060,196,425.94	97.75
	其中：债券	3,060,196,425.94	97.75
	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	-	-
	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	52,613,851.80	1.68
8	其他各项资产	17,877,124.11	0.57
9	合计	3,130,687,401.85	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投资股票。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票投资变动。

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	3,060,196,425.94	112.84
	其中：政策性金融债	1,746,606,898.00	64.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,060,196,425.94	112.84

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	200402	20 农发 02	6,500,000	638,779,449.57	23.55
2	200303	20 进出 03	4,500,000	441,377,056.16	16.27
3	2028004	20 浙商银行小微债 01	2,700,000	270,651,831.41	9.98
4	2028020	20 兴业银行小微债 03	2,700,000	266,991,088.44	9.84
5	2028002	20 渤海银行 02	2,500,000	251,612,306.73	9.28

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

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**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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**

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1“20 浙商银行小微债 01”发行人浙商银行股份有限公司因未按规定履行客户识别义务、未按规定保存客户身份材料及交易记录、未按规定进行可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，违反《反洗钱法》相关规定，中国人民银行杭州中心支行处以罚款合计 1010 万元。（杭银处罚字〔2019〕43 号，2019 年 12 月 31 日）

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内本基金投资的其他前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本基金的投资范围不包括股票。

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	-

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,877,124.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,877,124.11

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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
新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 A	194	13,917,771.10	2,700,017,000.00	100.00%	30,593.40	0.00%

新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 C	30	220.00	0.00	0.00%	6,600.08	100.00 %
合计	224	12,053,813.36	2,700,017,000.00	100.00%	37,193.48	0.00%

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	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 A	22,000.82	0.00%
	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 C	3,200.04	48.48%
	合计	25,200.86	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	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 A	0~10
	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 A	0~10
	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 C	0~10
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 A	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 12 日）基金份额总额	2,700,047,593.40	6,600.08
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	2,700,047,593.40	6,600.08
-------------	------------------	----------

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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，本基金基金管理人聘任翟晨曦女士担任公司董事职务，胡湘先生、刘成伟先生担任公司独立董事职务，副总经理崔建波、晏益民离任；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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所情况。

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，本基金无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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2个交易席位，其中报告期内新增2个交易席位，退租0个交易席位。其中新增席位为：恒泰证券上海席位、恒泰证券深圳席位。

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	-	-	25,305,400,000.00	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	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-01-03
2	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告	公司网站、电子信披网站	2020-01-03
3	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同	公司网站、电子信披网站	2020-01-03
4	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议	公司网站、电子信披网站	2020-01-03
5	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书	公司网站、电子信披网站	2020-01-03
6	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金提前结束募集的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-03-07
7	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-03-13
8	新华基金管理股份有限公司关于董事及独立董事变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2020-03-27
9	新华基金管理股份有限公司新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-05-13
10	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）全文	公司网站、电子信披网站	2020-05-14
11	新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	证券时报、公司网站、电子信披网站	2020-05-14
12	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	2020-06-06
13	新华基金管理股份有限公司关于取消武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构的公告的公告	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	2020-06-20
14	新华基金管理股份有限公司关于取消厦门市鑫鼎盛控股有限公司为销售机构的公告的公告	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	2020-06-30

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，并同时考虑其买入时的溢价和折价，确认利息收入并评估减值准备。本报告中投资组合报告的公允价值部分均以摊余成本列示。

2、本基金本报告期内未计提减值准备。

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泽 39 个月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泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
- (四) 新华安享惠泽 39 个月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) 《新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- (七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (八) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (九) 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询。

新华基金管理股份有限公司

二〇二〇年八月二十七日