

# 新华鑫日享中短债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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
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.....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	21
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
<b>5 托管人报告</b> .....	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
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.....	22
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	22
6.1 资产负债表.....	22
6.2 利润表.....	23
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	25
6.4 报表附注.....	26
<b>7 投资组合报告</b> .....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 本报告期投资基金情况.....	49
7.13 投资组合报告附注.....	49
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	51

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	52
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>52</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	53
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.9 其他重大事件 .....	54
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>57</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	58

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	新华鑫日享中短债债券型证券投资基金		
基金简称	新华鑫日享中短债债券		
基金主代码	004981		
交易代码	004981		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 12 月 19 日		
基金管理人	新华基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	4,627,368,159.22 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	新华鑫日享中短债债券 A	新华鑫日享中短债债券 C	新华鑫日享中短债债券 B
下属分级基金的交易代码	004981	006695	007912
报告期末下属分级基金的份额总额	3,649,271,796.08 份	297,604,326.29 份	680,492,036.85 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险和增强基金资产流动性的基础上，重点投资中短债主题证券，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	本基金投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、中小企业私募债券选择策略及资产支持证券的投资策略。 本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。
业绩比较基准	中债总财富（1-3 年）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，属于证券投资基金中预期较低风险、较低收益的品种，其预期收益和风险水平低于股票型基金、混合型基金，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	中国民生银行股份有限公司
信息披露	姓名	齐岩	罗菲菲
	联系电话	010-68779688	010-58560666

负责人	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95568
传真		010-68779528	010-57093382
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	北京市西城区复兴门内大街2 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	北京市西城区复兴门内大街2 号
邮政编码		400010	100031
法定代表人		翟晨曦	高迎欣

## 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	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

## 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）		
	新华鑫日享中短债债券 A	新华鑫日享中短债债券 C	新华鑫日享中短债债券 B
本期已实现收益	18,697,777.81	1,616,436.88	8,071,470.79
本期利润	19,859,389.62	1,849,464.80	8,975,524.81
加权平均基金份额本期利润	0.0155	0.0144	0.0130
本期加权平均净值利润率	1.41%	1.31%	1.23%
本期基金份额净值增长率	1.54%	1.38%	1.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
	新华鑫日享中短债债券 A	新华鑫日享中短债债券 C	新华鑫日享中短债债券 B
期末可供分配利润	347,919,139.40	25,993,990.65	36,212,717.96

期末可供分配基金份额利润	0.0953	0.0873	0.0532
期末基金资产净值	4,050,185,954.98	327,820,477.11	723,791,872.32
期末基金份额净值	1.1099	1.1015	1.0636
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
	新华鑫日享中短债债券 A	新华鑫日享中短债债券 C	新华鑫日享中短债债券 B
基金份额累计净值增长率	12.93%	11.79%	7.62%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

4、本基金于 2018 年 12 月 19 日基金合同生效；

5、本基金于 2019 年 10 月 11 日起新增 B 类基金份额，B 类基金份额代码为：007912。

### 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

新华鑫日享中短债债券 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	0.13%	0.01%	0.11%	0.02%	0.02%	-0.01%
过去三个月	0.81%	0.01%	0.79%	0.03%	0.02%	-0.02%
过去六个月	1.54%	0.01%	1.48%	0.03%	0.06%	-0.02%
过去一年	3.61%	0.02%	3.48%	0.03%	0.13%	-0.01%
过去三年	10.41%	0.02%	10.34%	0.05%	0.07%	-0.03%
自基金成立起至今	12.93%	0.02%	12.46%	0.05%	0.47%	-0.03%

新华鑫日享中短债债券 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	0.10%	0.01%	0.11%	0.02%	-0.01%	-0.01%
过去三个月	0.72%	0.01%	0.79%	0.03%	-0.07%	-0.02%
过去六个月	1.38%	0.01%	1.48%	0.03%	-0.10%	-0.02%
过去一年	3.31%	0.02%	3.48%	0.03%	-0.17%	-0.01%
过去三年	9.46%	0.02%	10.34%	0.05%	-0.88%	-0.03%

自基金成立起至今	11.79%	0.02%	12.46%	0.05%	-0.67%	-0.03%
----------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

## 新华鑫日享中短债债券 B

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	0.08%	0.01%	0.11%	0.02%	-0.03%	-0.01%
过去三个月	0.64%	0.01%	0.79%	0.03%	-0.15%	-0.02%
过去六个月	1.28%	0.01%	1.48%	0.03%	-0.20%	-0.02%
过去一年	3.08%	0.02%	3.48%	0.03%	-0.40%	-0.01%
自基金成立起至今	7.62%	0.02%	9.02%	0.05%	-1.40%	-0.03%

注：1、本基金于 2018 年 12 月 19 日基金合同生效；

2、本基金于 2019 年 10 月 11 日起新增 B 类基金份额，B 类基金份额代码为：007912；

3、本基金新增 B 类基金份额后，将分设 A 类、B 类、C 类三类基金份额，A 类基金份额代码为：004981；C 类基金份额代码为：006695。

4、本基金业绩比较基准为：中债总财富（1-3 年）指数收益率；

5、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

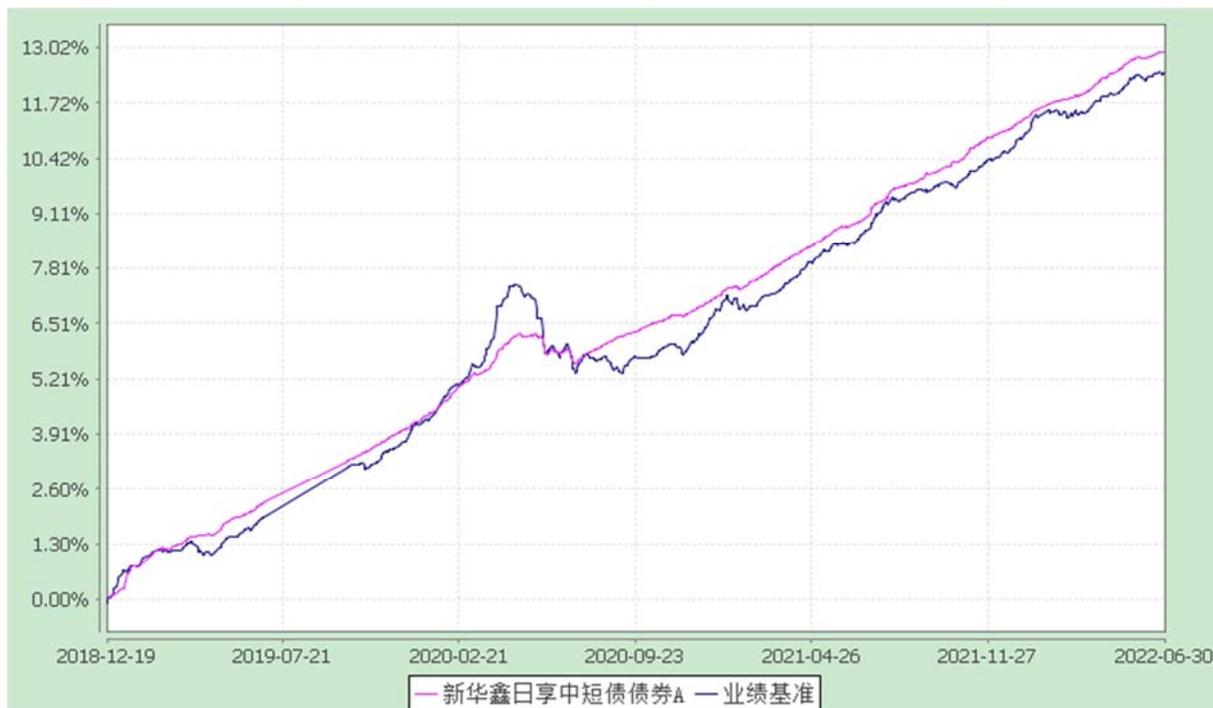
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华鑫日享中短债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

（2018 年 12 月 19 日至 2022 年 6 月 30 日）

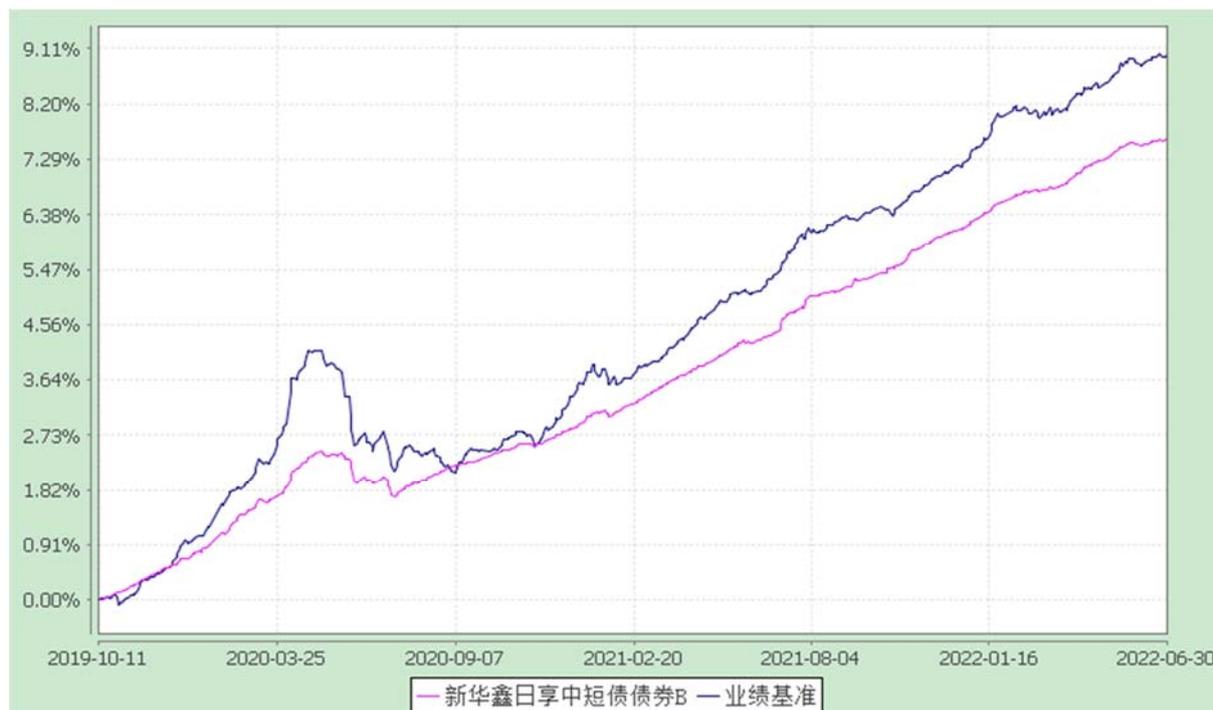
新华鑫日享中短债债券 A



新华鑫日享中短债债券 C



新华鑫日享中短债债券 B



- 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、本基金于 2019 年 10 月 11 日起新增 B 类基金份额。

## 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		
郑毅	本基金基金经理，总经理助理兼固定收益投资部总监，新华利率债债券型证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券	2021-11-26	-	11	学士。历任天风证券股份有限公司固定收益总部交易员、固收投资部副总经理、资管分公司策略投资一部总经理、资管分公司总经理助理。

	投资基金基金经理。				
赵楠	本基金基金经理，新华利率债债券型证券投资基金基金经理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理。	2018-12-19	-	10	经济学博士，历任新华基金管理股份有限公司宏观研究、策略研究、信用评级、基金经理助理。
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	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>金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华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</p>				
--	--	--	--	--	--

	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、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投	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。

	<p>资基金基金经 理助理、新华 鼎利债券型证 券投资基金基 金基金助理、 新华双利债券 型证券投资基金 基金基金助理 、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 基金基金助理 、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 基金基金助 理、新华安康 多元收益一年 持有期混合型 证券投资基金 基金基金助 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 基金基金助</p>				
--	---	--	--	--	--

	理。				
裴铎	<p>本基金基金经理助理，新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、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</p>	2022-05-19	-	6	国际经济学硕士，历任广发银行金融市场部交易员、投资经理。

	券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华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、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	2020-06-03	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>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</p>				
--	--	--	--	--	--

	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。				
--	-------------------------------------	--	--	--	--

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鑫日享中短债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》、《新华鑫日享中短债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《证券投资基金管理有限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

回顾上半年，国内外形势错综复杂，海外地缘政治冲突升级，大宗商品价格冲高，通胀高位运行，美联储连续加息，国内依然面临“三重压力”，叠加上海疫情，经济复苏节奏出现反复。数据上看，国内出口稳定增长，但工业生产、房地产和消费数据走弱，失业率抬升，制造业 PMI 在 3 月、4 月和 5 月处于收缩区间直至 6 月小幅回升至扩张区间，上半年国内生产总值同比增长 2.5%，其中二季度同比增长 0.4%。总体来看目前宏观经济仍然偏弱。在此背景下，整体政策以稳经济、稳投资、稳就业、扩内需为主要目标，货币政策维持稳健偏宽松，总量发力与结构性政策并举，1 月 LPR 利率下调，4 月存款准备金率下调，5 月 5 年期 LPR 利率下调，整体资金利率保持偏低水平，通胀压力仍存，海外货币政策转向压力上升，但不是目前的主要矛盾。上半年长端利率窄幅震荡，10 年期国债在 2.65%-2.85% 区间波动，半年末收于 2.82%。短端利率下行明显，曲线陡峭化。信用债方面，上半年净融资稳定增长，整体收益率走势和利率债相近，在配置需求的推动下，绝对收益和利差均处于低位，发行人之间的分化仍然严重，房地产行业仍在出清阶段。

本报告期内，基金规模有所上升，本基金秉持稳健投资原则谨慎操作，主要采用票息策略，久期基本控制在 0.5 年左右，债券投向以高资质高评级城投及产业债为主，严控信用风险不做信用下沉，同时根据规模及配置时点动态调整持仓提高组合整体流动性，结合资金面变化适度调整杠杆水平，在久期和交易策略上择机做出适度调整，继续执行货币加强策略以提供稳定回报为主要目标，在提供充分流动性保证的情况下为持有人获取了相对较好的投资回报。

#### 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 1.1099 元，本报告期份额净值增长率为 1.54%，同期比较基准的增长率为 1.48%；本基金 C 类份额净值为 1.1015 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 1.48%；本基金 B 类份额净值为 1.0636 元，本报告期份额净值增长率为 1.28%，同期比较基准的增长率为 1.48%。

#### 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，当前时间点面临的宏观格局是基建确定性反弹但只有阶段性表现，地产寻底，出口趋势上走弱但仍存韧性，消费修复需要时间。确定性在于经济疲弱，就业数据较差；依然处于货币宽松、流动性合理充裕阶段；不确定在于政策层面宽信用发力的程度、微观主体预期改变下宽货币向宽信用传导的有效性、疫情防控的短期和中长期趋势、以及短端市场利率的回归。考虑到今年的变量较多，周期环境与 2021 年也不相同，今年的策略跟去年有很大不同，继续保持震荡市思维，节奏尤其重要。

本基金在投资策略上将结合市场表现与流动性要求，采取较为灵活的策略应对收益率变化，动态调整组合久期和杠杆，在提供充分的流动性保证的情况下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

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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、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：新华鑫日享中短债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	118,734,448.59	15,598,985.70
结算备付金		34,287.20	192,807.30
存出保证金		1,419.18	12,496.34
交易性金融资产	6.4.7.2	4,430,291,489.92	1,725,758,900.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资	6.4.7.2	4,430,291,489.92	1,725,758,900.00
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	550,268,811.21	150,020,789.96
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		25,791,550.10	27,272,327.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	33,285,010.31
资产总计		5,125,122,006.20	1,952,141,316.94
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		3,509,088.74	223,654,424.85
应付清算款		-	-
应付赎回款		17,684,335.32	8,736,026.55
应付管理人报酬		858,208.83	276,578.51
应付托管费		286,069.62	92,192.84
应付销售服务费		442,433.90	104,019.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		365,310.09	127,030.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	178,255.29	300,542.54
负债合计		23,323,701.79	233,290,815.92
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	4,627,368,159.22	1,589,988,757.51
其他综合收益	6.4.7.1 1	-	-
未分配利润	6.4.7.12	474,430,145.19	128,861,743.51
净资产合计		5,101,798,304.41	1,718,850,501.02
负债和净资产总计		5,125,122,006.20	1,952,141,316.94

注: 报告截止日 2022 年 06 月 30 日, A 类基金份额净值 1.1099 元, A 类基金份额 3,649,271,796.08 份; C 类基金份额净值 1.1015 元, C 类基金份额 297,604,326.29 份; B 类基金份额净值 1.0636 元, B 类基金份额 680,492,036.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 新华鑫日享中短债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>39,913,953.35</b>	<b>14,399,893.37</b>
1.利息收入		1,136,035.15	14,755,651.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	726,780.73	23,277.67
债券利息收入		-	14,572,085.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		409,254.42	160,288.29
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		35,454,913.94	-3,137,603.61
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	35,454,913.94	-3,137,603.61
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,298,693.75	1,482,606.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,024,310.51	1,299,239.28
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>9,229,574.12</b>	<b>2,561,116.70</b>
1. 管理人报酬		3,357,964.13	1,020,991.25
2. 托管费		1,119,321.38	340,330.33
3. 销售服务费		2,084,369.80	546,906.54
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,332,547.02	423,082.73
其中：卖出回购金融资产支出		2,332,547.02	423,082.73
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		182,312.01	44,323.98
8. 其他费用	6.4.7.22	153,059.78	185,481.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>30,684,379.23</b>	<b>11,838,776.67</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>30,684,379.23</b>	<b>11,838,776.67</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>30,684,379.23</b>	<b>11,838,776.67</b>

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华鑫日享中短债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 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）	1,589,988,757.51	-	128,861,743.51	1,718,850,501.02
二、本期期初净资产（基金净值）	1,589,988,757.51	-	128,861,743.51	1,718,850,501.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,037,379,401.71	-	345,568,401.68	3,382,947,803.39
（一）、综合收益总额	-	-	30,684,379.23	30,684,379.23
（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）	3,037,379,401.71	-	314,884,022.45	3,352,263,424.16
其中：1.基金申购款	6,143,142,302.89	-	580,954,456.13	6,724,096,759.02
2.基金赎回款	-3,105,762,901.18	-	-266,070,433.68	-3,371,833,334.86
（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）	4,627,368,159.22	-	474,430,145.19	5,101,798,304.41
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）	1,626,909,934.68	-	105,376,258.11	1,732,286,192.79
二、本期期初净资产（基金净值）	1,626,909,934.68	-	105,376,258.11	1,732,286,192.79

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-403,617,598.40	0.00	-22,448,094.85	-426,065,693.25
（一）、综合收益总额	0.00	-	11,838,776.67	11,838,776.67
（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）	-403,617,598.40	-	-21,799,194.85	-425,416,793.25
其中：1.基金申购款	1,504,317,632.35	-	107,572,431.21	1,611,890,063.56
2.基金赎回款	-1,907,935,230.75	-	-129,371,626.06	-2,037,306,856.81
（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）	-	-	-12,487,676.67	-12,487,676.67
四、本期期末净资产（基金净值）	1,223,292,336.28	-	82,928,163.26	1,306,220,499.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至本报告 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

新华鑫日享中短债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 2017 年 7 月 10 日证监许可[2017]1190 号文准予注册并经证监许可[2018]1855 号文准予变更注册后募集。由新华基金管理股份有限公司于 2018 年 12 月 3 日至 2018 年 12 月 14 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 821,787,477.83 份，其中募集资金产生利息 62,995.50 元，有效认购户数为 2,668 户，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2018]01360035 号验资报告予以验证。2018 年 12 月 19 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不限定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《新华鑫日享中短债债券型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、

央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、中期票据、中小企业私募债、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、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、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券、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%，其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%。

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、解释及其他有关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括债券的差价收入,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。

(4) 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	38,625,837.65
等于：本金	38,621,884.85
加：应计利息	3,952.80
定期存款	80,108,610.94
等于：本金	80,000,000.00
加：应计利息	108,610.94
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	30,095,833.18
存款期限 3 个月以上	50,012,777.76
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	118,734,448.59

### 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	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	1,347,292.92		
	市场	68,423,915.79	69,803,092.92	31,884.21
	银行间		66,844,317.00	
	市场	4,290,065,064.24	4,360,488,397.00	3,579,015.76
合计	4,358,488,980.03	68,191,609.92	4,430,291,489.92	3,610,899.97
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	4,358,488,980.03	68,191,609.92	4,430,291,489.92	3,610,899.97

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 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	-	-
银行间市场	550,268,811.21	-
合计	550,268,811.21	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

### 6.4.7.8 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	70,076.34
其中：交易所市场	-
银行间市场	70,076.34
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	178,255.29

## 6.4.7.10 实收基金

新华鑫日享中短债债券 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	955,018,385.14	955,018,385.14
本期申购	4,237,039,022.29	4,237,039,022.29
本期赎回（以“-”号填列）	-1,542,785,611.35	-1,542,785,611.35
本期末	3,649,271,796.08	3,649,271,796.08

新华鑫日享中短债债券 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	221,511,896.08	221,511,896.08
本期申购	565,119,977.07	565,119,977.07
本期赎回（以“-”号填列）	-489,027,546.86	-489,027,546.86

本期末	297,604,326.29	297,604,326.29
-----	----------------	----------------

新华鑫日享中短债债券 B

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	413,458,476.29	413,458,476.29
本期申购	1,340,983,303.53	1,340,983,303.53
本期赎回（以“-”号填列）	-1,073,949,742.97	-1,073,949,742.97
本期末	680,492,036.85	680,492,036.85

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

新华鑫日享中短债债券 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	76,557,214.88	12,372,975.68	88,930,190.56
本期利润	18,697,777.81	1,161,611.81	19,859,389.62
本期基金份额交易产生的变动数	252,664,146.71	39,460,432.01	292,124,578.72
其中：基金申购款	389,466,699.61	60,876,942.45	450,343,642.06
基金赎回款	-136,802,552.90	-21,416,510.44	-158,219,063.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	347,919,139.40	52,995,019.50	400,914,158.90

新华鑫日享中短债债券 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	16,361,533.50	2,803,727.53	19,165,261.03
本期利润	1,616,436.88	233,027.92	1,849,464.80
本期基金份额交易产生的变动数	8,016,020.27	1,185,404.72	9,201,424.99
其中：基金申购款	47,366,935.65	7,853,642.48	55,220,578.13
基金赎回款	-39,350,915.38	-6,668,237.76	-46,019,153.14
本期已分配利润	-	-	-

本期末	25,993,990.65	4,222,160.17	30,216,150.82
-----	---------------	--------------	---------------

## 新华鑫日享中短债债券 B

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	17,086,054.80	3,680,237.12	20,766,291.92
本期利润	8,071,470.79	904,054.02	8,975,524.81
本期基金份额交易产生的变动数	11,055,192.37	2,502,826.37	13,558,018.74
其中：基金申购款	62,475,439.72	12,914,796.22	75,390,235.94
基金赎回款	-51,420,247.35	-10,411,969.85	-61,832,217.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,212,717.96	7,087,117.51	43,299,835.47

## 6.4.7.13 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	70,206.69
定期存款利息收入	655,735.94
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	838.10
其他	-
合计	726,780.73

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

## 6.4.7.14 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资。

## 6.4.7.15 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资。

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 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	54,729,213.44

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-19,274,299.50
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	35,454,913.94

#### 6.4.7.16.2 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	3,886,330,616.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,813,206,704.27
减：应计利息总额	92,313,658.60
减：交易费用	84,553.18
买卖债券差价收入	-19,274,299.50

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资。

#### 6.4.7.19 股利收益

本报告期，本基金无股利收益。

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	2,298,693.75
——股票投资	-
——债券投资	2,298,693.75
——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	2,298,693.75

#### 6.4.7.21 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	1,024,288.06
补差费收入	22.45
合计	1,024,310.51

#### 6.4.7.22 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	35,880.83
上清所证书使用费	600.00
账户维护费	17,400.00
证券日报	59,507.37
合计	153,059.78

### 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 2022 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

2022 年 7 月 27 日，本基金进行了 2022 年第一次分红。A 类每 10 份分配 0.50 元，C 类每 10 份分配 0.45 元，B 类每 10 份分配 0.35 元。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国民生银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金**

本报告期及上年度可比期间，本基金均无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 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	3,357,964.13	1,020,991.25
其中：支付销售机构的客户维护费	772,295.25	200,619.41

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 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×0.3%/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6
----	-------------------------	-----------------------------

	30日	月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,119,321.38	340,330.33

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值 0.10% 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×0.10%/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			
	新华鑫日享中短债债 券 A	新华鑫日享中短债 债券 C	新华鑫日享中短债债 券 B	合计
新华基金管 理股份有限 公司	-	54,663.11	-	54,663.11
中国民生银 行股份有限 公司	-	10,421.08	-	10,421.08
恒泰证券股 份有限公司	-	15,422.96	-	15,422.96
合计	-	80,507.15	-	80,507.15
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			
	新华鑫日享中短债债 券 A	新华鑫日享中短债 债券 C	新华鑫日享中短债债 券 B	合计
恒泰证券股 份有限公司	-	7.55	-	7.55
中国民生银 行股份有限 公司	-	9,310.80	-	9,310.80
新华基金管 理股份有限 公司	-	5,965.49	-	5,965.49
合计	-	15,283.84	-	15,283.84

注：1、A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金销售服务费按前一日的基金资产净值 3% 的年费率逐日计提确认，B 类基金销售服务费按前一日的基金资产净值 6% 的年费率逐日计提确认。

2、自 2021 年 11 月 24 日至 2022 年 2 月 23 日对 B 类基金销售服务费实施销售服务费优惠，优惠期间 B 类基金销售服务费费率由 6% 变为 3%。

## 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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银 行股份有限 公司	20,001,441.10	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

## 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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

## 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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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		
	新华鑫日享中 短债债券A	新华鑫日享中 短债债券C	新华鑫日享中 短债债券B	新华鑫日享中 短债债券A	新华鑫日享中 短债债券C	新华鑫日享中 短债债券B
期初持有的基	9,676,763.77	-	-	9,676,763.77	-	-

金份额						
期间申购/买入 总份额	-	-	-	-	-	-
期间因拆分变 动份额	-	-	-	-	-	-
减：期间赎回/ 卖出总份额	9,676,763.77	-	-	-	-	-
期末持有的基 金份额	0.00	-	-	9,676,763.77	-	-
期末持有的基 金份额 占基金总份 额比例	0.00%	-	-	0.92%	-	-

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

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	38,625,837.65	70,206.69	4,416,142.87	23,022.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内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

本报告期，本基金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

截止报告期期末本基金未持有流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至报告期期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,500,000.00 元，于 2022 年 7 月 20 日（含）前全部到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按交易所市场规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 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	113,055,598.36	120,858,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	253,216,235.61	718,887,900.00
合计	366,271,833.97	839,745,900.00

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本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	1,866,382,728.49	221,785,000.00
AAA 以下	1,793,261,952.11	493,315,000.00
未评级	404,374,975.35	170,913,000.00
合计	4,064,019,655.95	886,013,000.00

**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**

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约

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	118,734,448.59	-	-	-	118,734,448.59
结算备付金	34,287.20	-	-	-	34,287.20
存出保证金	1,419.18	-	-	-	1,419.18
交易性金融资产	3,632,661,168.61	660,697,057.76	136,933,263.55	-	4,430,291,489.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	550,268,811.21	-	-	-	550,268,811.21
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	-	-	-	25,791,550.10	25,791,550.10
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,301,700,134.79	660,697,057.76	136,933,263.55	25,791,550.10	5,125,122,006.20
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	3,509,088.74	-	-	-	3,509,088.74
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	17,684,335.32	17,684,335.32
应付管理人报酬	-	-	-	858,208.83	858,208.83
应付托管费	-	-	-	286,069.62	286,069.62
应付销售服务费	-	-	-	442,433.90	442,433.90
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	365,310.09	365,310.09
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	178,255.29	178,255.29
负债总计	3,509,088.74	-	-	19,814,613.05	23,323,701.79
利率敏感度缺口	4,298,191,046.05	660,697,057.76	136,933,263.55	5,976,937.05	5,101,798,304.41
<b>上年度末</b>					
<b>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	15,598,985.70	-	-	-	15,598,985.70
结算备付金	-	-	-	192,807.30	192,807.30
存出保证金	12,496.34	-	-	-	12,496.34
交易性金融资产	1,393,019,100.00	322,335,800.00	10,404,000.00	-	1,725,758,900.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资	150,020,789.96	-	-	-	150,020,789.96

产					6
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	27,272,327.33	27,272,327.33
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	33,285,010.31	33,285,010.31
资产总计	1,558,651,372.00	322,335,800.00	10,404,000.00	60,750,144.94	1,952,141,316.94
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	223,654,424.85	-	-	-	223,654,424.85
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,736,026.55	8,736,026.55
应付管理人报酬	-	-	-	276,578.51	276,578.51
应付托管费	-	-	-	92,192.84	92,192.84
应付销售服务费	-	-	-	104,019.88	104,019.88
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	127,030.75	127,030.75
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	300,542.54	300,542.54
负债总计	223,654,424.85	-	-	9,636,391.07	233,290,815.92
利率敏感度缺口	1,334,996,947.15	322,335,800.00	10,404,000.00	51,113,753.87	1,718,850,501.02

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 25bp	-7,328,428.72

市场利率下降 25bp	7,396,967.78	2,433,319.70
-------------	--------------	--------------

#### 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 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	4,430,291,48 9.92	86.84	1,725,758,900 .00	100.40
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	4,430,291,48 9.92	86.84	1,725,758,900 .00	100.40

#### 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	-
第二层次	4,430,291,489.92
第三层次	-
合计	4,430,291,489.92

##### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,430,291,489.92	86.44
	其中：债券	4,430,291,489.92	86.44
	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	550,268,811.21	10.74
	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	118,768,735.79	2.32
8	其他各项资产	25,792,969.28	0.50
9	合计	5,125,122,006.20	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股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	667,905,567.67	13.09
	其中：政策性金融债	657,591,210.96	12.89
4	企业债券	528,863,947.02	10.37
5	企业短期融资券	2,147,421,040.00	42.09
6	中期票据	1,086,100,935.23	21.29
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,430,291,489.92	86.84

## 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	220201	22 国开 01	1,500,000	151,586,547.95	2.97

2	092218001	22 农发清发 01	1,000,000	100,658,493.15	1.97
3	012281269	22 济南城建 SCP005	800,000	80,573,330.41	1.58
4	012281342	22 上海机场 SCP003	800,000	80,370,082.19	1.58
5	012281438	22 东航股 SCP012	800,000	80,337,534.25	1.57

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同尚无股指期货投资政策。

#### 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

本基金本报告期末尚无国债期货投资政策。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

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

本报告期末本基金未持有基金。

#### 7.13 投资组合报告附注

##### 7.13.1

1、“22 国开 01”发行人国家开发银行：因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送 17 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 440 万元。（银保监罚决字〔2022〕8

号，2022 年 3 月 21 日）

2、“22 农发清发 01”的发行人中国农业发展银行，因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送 17 项违法违规行为被罚款 480 万元。【银保监罚决字（2022）10 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 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

### 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	1,419.18
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,791,550.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,792,969.28

### 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

本报告期末本基金未持有股票。

### 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
新华鑫日享中短债债券 A	14,495	251,760.73	3,314,302,647.34	90.82%	334,969,148.74	9.18%
新华鑫日享中短债债券 C	13,254	22,453.93	121,950,979.38	40.98%	175,653,346.91	59.02%
新华鑫日享中短债债券 B	48,979	13,893.55	16,750,808.91	2.46%	663,741,227.94	97.54%
合计	76,728	60,308.73	3,453,004,435.63	74.62%	1,174,363,723.59	25.38%

## 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	新华鑫日享中短债债券 A	2,862,467.24	0.08%
	新华鑫日享中短债债券 C	298,084.49	0.10%
	新华鑫日享中短债债券 B	9,722.78	0.00%
	合计	3,170,274.51	0.07%

## 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	新华鑫日享中短债债券 A	>100
	新华鑫日享中短债债券 C	0
	新华鑫日享中短债债券 B	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	新华鑫日享中短债债券 A	0
	新华鑫日享中短债债券 C	0
	新华鑫日享中短债债券 B	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华鑫日享中短债债券 A	新华鑫日享中短债债券 C	新华鑫日享中短债债券 B
基金合同生效日（2018年12月19日）基金份额总额	113,311,364.42	708,476,113.41	-
本报告期期初基金份额总额	955,018,385.14	221,511,896.08	413,458,476.29
本报告期基金总申购份额	4,237,039,022.29	565,119,977.07	1,340,983,303.53
减：本报告期基金总赎回份额	1,542,785,611.35	489,027,546.86	1,073,949,742.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,649,271,796.08	297,604,326.29	680,492,036.85

## 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内本基金未有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

**10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件**

本报告期本基金未持有基金。

**10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况**

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及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

**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	
光大证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	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2个交易席位，其中报告期内新增0个交易席位，退租0个交易席位。

**一、交易席位的分配依据**

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

## 二、交易席位的选择流程

1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。

2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

## 三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员分别打分，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
光大证券	37,636,082.83	100.00%	57,000,000.00	100.00%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

### 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
3	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
4	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
5	新华鑫日享中短债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
6	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
7	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
8	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
9	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金增加华鑫证券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参加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	2022-03-12
10	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中信百信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	2022-03-16
11	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
13	新华基金管理股份有限公司关于新华鑫日享中短债债券型证券投资基金增加光大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	证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-28
12	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
14	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
15	新华鑫日享中短债债券型证券投资基金 2021	公司网站、电子信披网站	2022-03-30

	年年度报告		
16	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
17	新华基金管理股份有限公司关于新华鑫日享中短债债券型证券投资基金增加安信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	证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-20
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
20	新华鑫日享中短债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
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	2022-04-21
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新华鑫日享中短债债券型证券投资基金增加东吴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	证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-29
24	新华基金管理股份有限公司关于新华鑫日享中短债债券型证券投资基金增加申万宏源证券有限公司、申万宏源西部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	证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-29
25	新华基金管理股份有限公司关于新华鑫日享中短债债券型证券投资基金增加湘财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	证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-29
26	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增加博时财富基金销售有限公司作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	2022-05-09
27	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加嘉实财富管理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	证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-05-10

28	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金增加中原证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证券报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-05-31
29	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
30	新华基金管理股份有限公司关于新华鑫日享中短债债券型证券投资基金增加山西证券股份有限公司为销售机构参加费率优惠活动的公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-06-16
31	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 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内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鑫日享中短债债券型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新华鑫日享中短债债券型证券投资基金之法律意见书
- (三) 新华鑫日享中短债债券型证券投资基金托管协议
- (四) 新华鑫日享中短债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) 《新华鑫日享中短债债券型证券投资基金招募说明书》（更新）
- (七) 《新华鑫日享中短债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) 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