

新华鑫日享中短债债券型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：二〇二三年八月三十日

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 2023 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 2023 年 1 月 1 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 | 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..... | 22 |
| 5 托管人报告 | 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的真实、准确和完整发表意见..... | 22 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 22 |
| 6.1 资产负债表..... | 22 |
| 6.2 利润表..... | 24 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 25 |
| 6.4 报表附注..... | 26 |
| 7 投资组合报告 | 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..... | 47 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 47 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 47 |
| 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..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 48 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 48 |
| 7.12 本报告期投资基金情况..... | 49 |
| 7.13 投资组合报告附注..... | 49 |
| 8 基金份额持有人信息 | 50 |

| | |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 50 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 50 |
| 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 | 51 |
| 9 开放式基金份额变动 | 51 |
| 10 重大事件揭示 | 52 |
| 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 | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 52 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 52 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 52 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 52 |
| 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 | 52 |
| 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 |
| 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 56 |
| 12 备查文件目录 | 56 |
| 12.1 备查文件目录 | 56 |
| 12.2 存放地点 | 57 |
| 12.3 查阅方式 | 57 |

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 | 1,251,624,911.65 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 | 912,198,584.98 份 | 130,836,404.07 份 | 208,589,922.60 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 | qiyang@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 | | 于春玲 | 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 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 | 13,758,763.36 | 1,087,760.12 | 2,680,308.27 |
| 本期利润 | 19,339,738.85 | 1,548,282.69 | 4,014,315.13 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0179 | 0.0160 | 0.0170 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.73% | 1.56% | 1.66% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.75% | 1.60% | 1.67% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 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 | 24,884,027.28 | 3,010,451.07 | 4,147,049.29 |

| | | | |
|--------------|-----------------------|----------------|----------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0273 | 0.0230 | 0.0199 |
| 期末基金资产净值 | 951,095,748.22 | 135,812,176.89 | 215,084,808.80 |
| 期末基金份额净值 | 1.0426 | 1.0380 | 1.0311 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 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 | 15.74% | 14.22% | 10.00% |

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 | 0.17% | 0.02% | 0.32% | 0.03% | -0.15% | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.82% | 0.01% | 1.13% | 0.03% | -0.31% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.75% | 0.01% | 1.66% | 0.03% | 0.09% | -0.02% |
| 过去一年 | 2.48% | 0.02% | 2.90% | 0.04% | -0.42% | -0.02% |
| 过去三年 | 9.33% | 0.02% | 9.22% | 0.04% | 0.11% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 15.74% | 0.02% | 15.73% | 0.04% | 0.01% | -0.02% |

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 | 0.14% | 0.01% | 0.32% | 0.03% | -0.18% | -0.02% |
| 过去三个月 | 0.75% | 0.01% | 1.13% | 0.03% | -0.38% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.60% | 0.01% | 1.66% | 0.03% | -0.06% | -0.02% |
| 过去一年 | 2.18% | 0.02% | 2.90% | 0.04% | -0.72% | -0.02% |
| 过去三年 | 8.37% | 0.02% | 9.22% | 0.04% | -0.85% | -0.02% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 14.22% | 0.02% | 15.73% | 0.04% | -1.51% | -0.02% |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|

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 | 0.17% | 0.01% | 0.32% | 0.03% | -0.15% | -0.02% |
| 过去三个月 | 0.81% | 0.01% | 1.13% | 0.03% | -0.32% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.67% | 0.01% | 1.66% | 0.03% | 0.01% | -0.02% |
| 过去一年 | 2.21% | 0.02% | 2.90% | 0.04% | -0.69% | -0.02% |
| 过去三年 | 7.84% | 0.02% | 9.22% | 0.04% | -1.38% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.00% | 0.02% | 12.19% | 0.05% | -2.19% | -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。

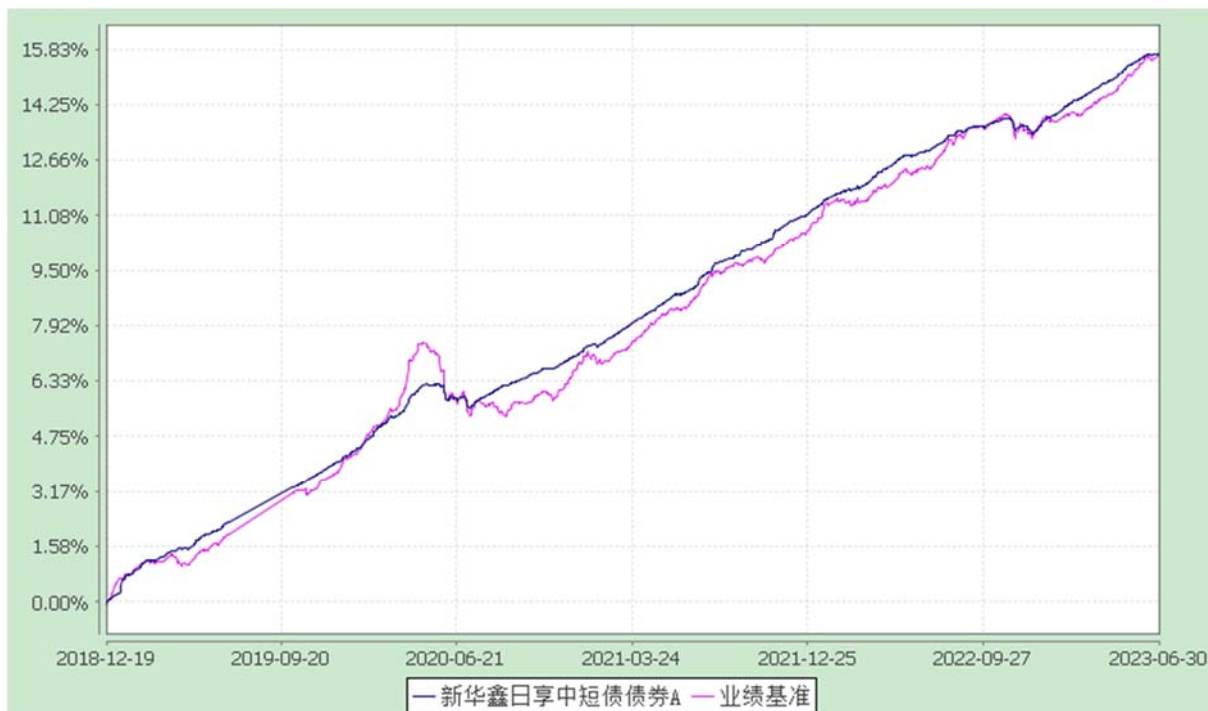
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华鑫日享中短债债券型证券投资基金

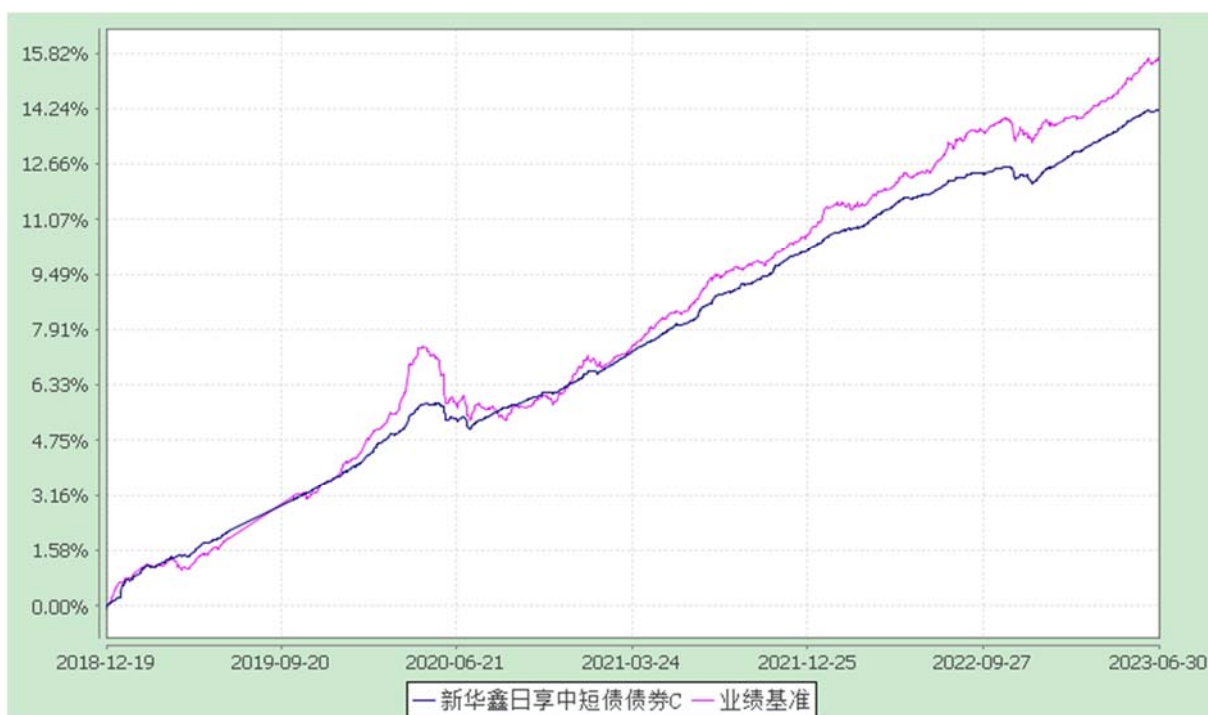
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2018 年 12 月 19 日至 2023 年 6 月 30 日）

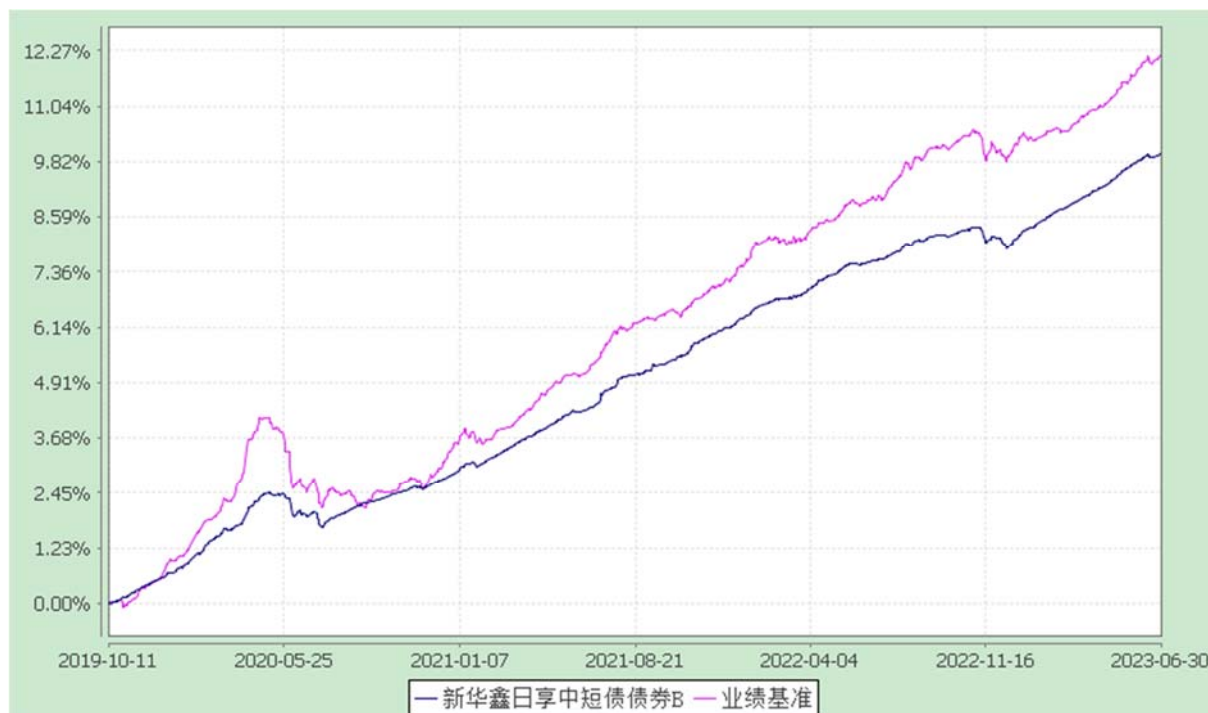
新华鑫日享中短债债券 A



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 2023 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十八只开放式基金，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基金基金经理、新华安享惠金定期开 | 2021-11-26 | - | 12 | 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。 |

| | | | | | |
|-----|--|------------|---|----|--|
| | 放债券型证券投资基金基金经理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理。 | | | | |
| 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。 | 2018-12-19 | - | 11 | 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。 |
| 万昱东 | 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、 | 2022-12-13 | - | 5 | 统计学硕士，历任天风证券固定收益总部分析师。 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | <p>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、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</p> | | | | |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|-----|--|------------|---|---|-------------------------------|
| | 惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。 | | | | |
| 杨卓谕 | 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 | 2022-12-13 | - | 5 | 金融硕士。曾任职于天风证券机构投顾总部产品助理，投资经理。 |

| | | | | | |
|-----|---|------------|---|---|--|
| | 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。 | | | | |
| 朱韦康 | 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 | 2022-12-28 | - | 6 | 经济学博士，历任中金公司固定收益分析师，建信信托宏观策略投资和资产配置研究。 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | <p>券投资基金基金 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 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 金基金经理助 理、新华鑫回 报混合型证 券投资基金基 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 金基金经理助 理、新华聚利 债券型投资基 金基金经理助 理、新华丰利 债券型投资基 金基金经理助 理、新华增强 债券型投资基 金基金经理助 理、</p> | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

| | | | | | |
|-----|--|------------|------------|----|------------------------------------|
| | 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。 | | | | |
| 李晓然 | 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、 | 2021-03-01 | 2023-02-22 | 10 | 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>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、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</p> | | | | |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|------------------------|--|--|--|--|
| | 惠金定期开放债券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、本基金基金经理郑毅于 2023 年 7 月 19 日离任。

5、本基金基金经理助理万昱东、杨卓谕于 2023 年 7 月 5 日离任。

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所对手询价、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，海外地缘政治冲突依旧，通胀高位运行，美联储仍在加息周期，国内宏观经济一季度开始复苏但二季度未能延续复苏态势，总体仍然偏弱。数据上看，上半年国内消费数据开始修复，出口和房地产数据波动，制造业 PMI 在二季度重新回到收缩区间，CPI 持续低位，实体融资需求偏弱。在此背景下，今年整体政策取向稳健，以稳增长、稳物价、稳就业为主，恢复和扩大消费为优先，货币政策维持稳定性和持续性，总量和结构性政策兼有，强调跨周期调节，随着经济形势变化适度调整，6 月 7 天逆回购、SLF、LPR 利率先后下调。一季度利率债窄幅震荡，10 年期国债在 2.81%-2.93%区间波动，季末收于 2.85%；资金面波动较前期放大，1 年期国债在 2.07%-2.33%区间波动，季末收于 2.23%，曲线趋于平坦；进入二季度利率债震荡下行，10 年期国债下行 22bp 至 2.64%；资金中枢较一季度有所下行，1 年期国债下行 36bp 至 1.87%，曲线走陡。信用债方面，一季度市场情绪明显改善，供给上升，收益率下行较快，票息策略占优；二季度市场情绪较一季度有所弱化，市场风险偏好趋于下降，不同类别债券走势分化，绝对收益和利差仍处于较低水平。

本报告期内，主要采用票息和杠杆策略，阶段性交易策略，债券投向以高资质高评级产业为主，短久期城投为辅，同时阶段性增配偏利率品种，以提供稳定回报为主要目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0426 元，本报告期份额净值增长率为 1.75%，同期比较基准的增长率为 1.66%；本基金 C 类份额净值为 1.0380 元，本报告期份额净值增长率为

1.60%，同期比较基准的增长率为 1.66%；本基金 B 类份额净值为 1.0311 元，本报告期份额净值增长率为 1.67%，同期比较基准的增长率为 1.66%。

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，库存周期来看或从主动去库存过度到被动去库周期，当前从量价指标来看处于企业加速去库存阶段。三季度，透支效应在二季度集中体现之后，三季度大概率减弱；库存周期对经济的拖累也将减缓，经济环比增速在二季度明显放缓之后三季度或在探底寻找拐点。供需方面，由于上半年利率债发行节奏较慢，三季度或加快发行；需求端，一方面是总量一方面是结构调整，上半年一般是需求集中释放阶段，但从盘面和实际负债需求来看，配置需求一直存在。此外，银行息差特别是大行、城商行息差低于 1.8% 的临界点，存款利率仍有下调的空间，节奏不明。当前利率点位下市场对政策预期敏感，但目前市场一方面关注政策另一方面对政策预期也很弱。总之，经济快速下行阶段已过，但基本面的风险不大，由于机构持仓结构、政策预期等会对市场造成扰动，同时要观测是否形成了新的降低存款利率或其他宽松预期。

本基金在投资策略上将结合市场情况和资金利率水平动态调整组合久期和杠杆，综合考虑资产的流动性、收益性，重点配置高资质高评级城投及产业债，交易策略择机参与，力争打造更好的风险收益特征，为投资者提供稳定回报。

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》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，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约定进行。

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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 12,413,842.44 | 8,359,071.97 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 1,037.37 | 6,359.39 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,596,773,860.33 | 1,518,884,304.14 |

| | | | |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,596,773,860.33 | 1,518,884,304.14 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 18,301,234.54 | 4,153,580.14 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 1,627,489,974.68 | 1,531,403,315.64 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 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 | | 324,504,412.73 | 256,912,474.03 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 104,230.00 | - |
| 应付管理人报酬 | | 394,870.32 | 333,729.41 |
| 应付托管费 | | 131,623.44 | 111,243.14 |
| 应付销售服务费 | | 37,182.23 | 88,114.77 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 155,630.10 | 131,987.87 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.3 | 169,291.95 | 261,623.97 |
| 负债合计 | | 325,497,240.77 | 257,839,173.19 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.4 | 1,251,624,911.65 | 1,245,658,340.95 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.5 | 50,367,822.26 | 27,905,801.50 |
| 净资产合计 | | 1,301,992,733.91 | 1,273,564,142.45 |
| 负债和净资产总计 | | 1,627,489,974.68 | 1,531,403,315.64 |

注：截止 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0426 元，基金 A 类份额总额 912,198,584.98 份；本基金 C 类份额净值为 1.0380 元，基金 C 类份额总额 130,836,404.07 份；本基金 B 类份额净值为 1.0311 元，基金 B 类份额总额 208,589,922.60 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 30,849,416.83 | 39,913,953.35 |
| 1.利息收入 | | 114,826.52 | 1,136,035.15 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.6 | 22,673.27 | 726,780.73 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 92,153.25 | 409,254.42 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 23,168,994.59 | 35,454,913.94 |
| 其中：股票投资收益 | | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.7 | 23,168,994.59 | 35,454,913.94 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.8 | 7,375,504.92 | 2,298,693.75 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.9 | 190,090.80 | 1,024,310.51 |
| 减：二、营业总支出 | | 5,947,080.16 | 9,229,574.12 |
| 1. 管理人报酬 | | 2,162,383.34 | 3,357,964.13 |
| 2. 托管费 | | 720,794.43 | 1,119,321.38 |
| 3. 销售服务费 | | 359,155.35 | 2,084,369.80 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 2,460,206.31 | 2,332,547.02 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 2,460,206.31 | 2,332,547.02 |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 98,616.51 | 182,312.01 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.10 | 145,924.22 | 153,059.78 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 24,902,336.67 | 30,684,379.23 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 24,902,336.67 | 30,684,379.23 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |

| | | | |
|----------|--|---------------|---------------|
| 六、综合收益总额 | | 24,902,336.67 | 30,684,379.23 |
|----------|--|---------------|---------------|

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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） | 1,245,658,340.95 | - | 27,905,801.50 | 1,273,564,142.45 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 1,245,658,340.95 | - | 27,905,801.50 | 1,273,564,142.45 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 5,966,570.70 | - | 22,462,020.76 | 28,428,591.46 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 24,902,336.67 | 24,902,336.67 |
| （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） | 5,966,570.70 | - | -2,440,315.91 | 3,526,254.79 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,435,461,220.42 | - | 47,144,505.46 | 1,482,605,725.88 |
| 2.基金赎回款 | -1,429,494,649.72 | - | -49,584,821.37 | -1,479,079,471.09 |
| （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） | 1,251,624,911.65 | - | 50,367,822.26 | 1,301,992,733.91 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 |

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：于春玲，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 2023 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

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

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 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|-----------------|
| 活期存款 | 12,413,842.44 |
| 等于：本金 | 12,412,443.04 |
| 加：应计利息 | 1,399.40 |
| 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 | 12,413,842.44 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 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 | - | - | - |
| | 市场 | - | - | - |
| | 银行间 | 22,395,760.33 | - | - |
| | 市场 | 1,572,678,133.89 | 1,596,773,860.33 | 1,699,966.11 |
| 合计 | 1,572,678,133.89 | 22,395,760.33 | 1,596,773,860.33 | 1,699,966.11 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,572,678,133.89 | 22,395,760.33 | 1,596,773,860.33 | 1,699,966.11 |

6.4.7.3 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2023 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 | 61,113.00 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 61,113.00 |
| 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 | 169,291.95 |

6.4.7.4 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 | |
|---------------|----------------------|-------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 932,602,151.85 | 932,602,151.85 |
| 本期申购 | 1,105,143,580.46 | 1,105,143,580.46 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,125,547,147.33 | -1,125,547,147.33 |
| 本期末 | 912,198,584.98 | 912,198,584.98 |

新华鑫日享中短债债券 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|---------------|----------------------|-----------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 53,040,722.92 | 53,040,722.92 |
| 本期申购 | 256,878,856.28 | 256,878,856.28 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -179,083,175.13 | -179,083,175.13 |
| 本期末 | 130,836,404.07 | 130,836,404.07 |

新华鑫日享中短债债券 B

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 260,015,466.18 | 260,015,466.18 |
| 本期申购 | 73,438,783.68 | 73,438,783.68 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -124,864,327.26 | -124,864,327.26 |
| 本期末 | 208,589,922.60 | 208,589,922.60 |

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.5 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 | 13,812,848.04 | 9,239,494.36 | 23,052,342.40 |
| 本期利润 | 13,758,763.36 | 5,580,975.49 | 19,339,738.85 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,687,584.12 | -807,333.89 | -3,494,918.01 |
| 其中：基金申购款 | 22,020,766.68 | 15,590,162.59 | 37,610,929.27 |
| 基金赎回款 | -24,708,350.80 | -16,397,496.48 | -41,105,847.28 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 24,884,027.28 | 14,013,135.96 | 38,897,163.24 |

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 | 641,613.34 | 508,238.04 | 1,149,851.38 |
| 本期利润 | 1,087,760.12 | 460,522.57 | 1,548,282.69 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,281,077.61 | 996,561.14 | 2,277,638.75 |
| 其中：基金申购款 | 4,350,703.53 | 3,509,730.97 | 7,860,434.50 |
| 基金赎回款 | -3,069,625.92 | -2,513,169.83 | -5,582,795.75 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,010,451.07 | 1,965,321.75 | 4,975,772.82 |

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 | 2,180,918.66 | 1,522,689.06 | 3,703,607.72 |
| 本期利润 | 2,680,308.27 | 1,334,006.86 | 4,014,315.13 |
| 本期基金份额交易产生的 | -714,177.64 | -508,859.01 | -1,223,036.65 |

| | | | |
|----------|---------------|---------------|---------------|
| 变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 944,605.23 | 728,536.46 | 1,673,141.69 |
| 基金赎回款 | -1,658,782.87 | -1,237,395.47 | -2,896,178.34 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 4,147,049.29 | 2,347,836.91 | 6,494,886.20 |

6.4.7.6 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 22,624.10 |
| 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 | 49.17 |
| 其他 | - |
| 合计 | 22,673.27 |

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

6.4.7.7 债券投资收益

6.4.7.7.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 30,253,465.56 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -7,084,470.97 |
| 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 | 23,168,994.59 |

6.4.7.7.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 2,754,725,241.02 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,716,266,447.43 |

| | |
|----------|---------------|
| 减：应计利息总额 | 45,492,609.56 |
| 减：交易费用 | 50,655.00 |
| 买卖债券差价收入 | -7,084,470.97 |

6.4.7.8 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 7,375,504.92 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 7,375,504.92 |
| ——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 | 7,375,504.92 |

6.4.7.9 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 190,090.80 |
| 合计 | 190,090.80 |

6.4.7.10 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023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 | 28,445.27 |
| 上清所证书使用费 | 600.00 |
| 账户维护费 | 17,700.00 |
| 证券日报 | 59,507.37 |
| 合计 | 145,924.22 |

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 2023 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重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------|-------------|
| 新华基金管理股份有限公司 | 基金管理人、基金发起人 |
| 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 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月 30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,162,383.34 | 3,357,964.13 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 452,305.15 | 772,295.25 |

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 2023年1月1日至2023年6月 30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 720,794.43 | 1,119,321.38 |

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 2023年1月1日至2023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 券 B | 合计 |
| 中国民生银 行股份有限 公司 | - | 59,698.69 | - | 59,698.69 |
| 新华基金管 理股份有限 公司 | - | 3,767.51 | - | 3,767.51 |
| 恒泰证券股 份有限公司 | - | 18,028.08 | - | 18,028.08 |
| 合计 | - | 81,494.28 | - | 81,494.28 |
| 获得销售服 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |

| 务费的各关联方名称 | 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 |

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%；自 2022 年 8 月 11 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%；自 2023 年 3 月 31 日起对 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 3% 变为 0.5%。

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 2023年1月1日至2023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 |
| - | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 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 | - | - | - | - | - |

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固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | | 上年度可比期间 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 | 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 |
| 期初持有的基金份额 | - | - | - | 9,676,763.77 | - | - |
| 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 | - | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - | - | 0.00% | - | - |

注：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

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 |
|-------|----|---------|
| | | |

| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 2022年1月1日至2022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 | 12,413,842.44 | 22,624.10 | 38,625,837.65 | 70,206.69 |

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（2023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

截至本报告期末 2023 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 324,504,412.73 元，是以如下债券作为质押：

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 |
|-----------|-------------------|------------|------------|------------|---------------|
| 230201 | 23 国开 01 | 2023-07-03 | 100.97 | 700,000.00 | 70,679,095.63 |
| 2328017 | 23 农业银行 三农债 | 2023-07-03 | 100.28 | 400,000.00 | 40,113,923.50 |
| 102101366 | 21 国网租赁 MTN001 | 2023-07-03 | 103.05 | 300,000.00 | 30,913,688.22 |
| 102101011 | 21 国家能源 | 2023-07-03 | 100.97 | 300,000.00 | 30,291,934.43 |

| | | | | | |
|-----------|------------------------|------------|--------|--------------|----------------|
| | MTN001 | | | | |
| 210406 | 21 农发 06 | 2023-07-03 | 103.26 | 209,000.00 | 21,580,853.29 |
| 102101406 | 21 国能生物 MTN001 | 2023-07-03 | 105.28 | 200,000.00 | 21,056,735.34 |
| 2080214 | 20 河钢债 03 | 2023-07-03 | 103.36 | 200,000.00 | 20,672,147.95 |
| 2328018 | 23 兴业银行 绿色金融债 02 | 2023-07-03 | 100.21 | 200,000.00 | 20,042,745.36 |
| 102100195 | 21 河钢集 MTN001 | 2023-07-03 | 103.67 | 100,000.00 | 10,366,517.81 |
| 101900466 | 19 涪陵国资 MTN001 | 2023-07-03 | 102.71 | 100,000.00 | 10,271,020.77 |
| 102100113 | 21 珠海港 MTN001 | 2023-07-03 | 102.61 | 100,000.00 | 10,260,578.08 |
| 012380114 | 23 海沧投资 SCP001 | 2023-07-03 | 102.19 | 100,000.00 | 10,219,040.55 |
| 012380560 | 23 无锡国发 SCP001 | 2023-07-03 | 101.18 | 100,000.00 | 10,118,172.60 |
| 042380242 | 23 平安租赁 CP005 | 2023-07-03 | 100.78 | 100,000.00 | 10,078,091.80 |
| 012381158 | 23 常德经建 SCP001 | 2023-07-03 | 100.94 | 89,000.00 | 8,983,878.85 |
| 042380142 | 23 海淀国资 CP003 | 2023-07-03 | 101.32 | 85,000.00 | 8,612,452.68 |
| 102280210 | 22 平安租赁 MTN001 | 2023-07-03 | 101.64 | 73,000.00 | 7,420,022.00 |
| 012300224 | 23 新投 SCP001 | 2023-07-03 | 101.28 | 70,000.00 | 7,089,875.41 |
| 合计 | | | | 3,426,000.00 | 348,770,774.27 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末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 2023年6月30日 | 上年末 2022年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | - | 51,325,679.45 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 91,028,275.96 | 90,968,879.45 |
| 合计 | 91,028,275.96 | 142,294,558.90 |

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年末，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 2023年6月30日 | 上年末 2022年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA | 552,845,675.13 | 430,453,672.99 |
| AAA 以下 | 851,279,748.48 | 834,868,242.11 |
| 未评级 | 101,620,160.76 | 111,267,830.14 |
| 合计 | 1,505,745,584.37 | 1,376,589,745.24 |

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年末，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 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----|-------|-------|-------|-----|----|
| | | | | | |

| | | | | | |
|------------|------------------|----------------|---|---------------|------------------|
| 2023年6月30日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 12,413,842.44 | - | - | - | 12,413,842.44 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 1,037.37 | - | - | - | 1,037.37 |
| 交易性金融资产 | 1,103,747,447.43 | 493,026,412.90 | - | - | 1,596,773,860.33 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | 18,301,234.54 | 18,301,234.54 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,116,162,327.24 | 493,026,412.90 | - | 18,301,234.54 | 1,627,489,974.68 |
| 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 | 324,504,412.73 | - | - | - | 324,504,412.73 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 104,230.00 | 104,230.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 394,870.32 | 394,870.32 |
| 应付托管费 | - | - | - | 131,623.44 | 131,623.44 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 37,182.23 | 37,182.23 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 155,630.10 | 155,630.10 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 169,291.95 | 169,291.95 |
| 负债总计 | 324,504,412.73 | - | - | 992,828.04 | 325,497,240.77 |
| 利率敏感度缺口 | 791,657,914.51 | 493,026,412.90 | - | 17,308,406.50 | 1,301,992,733. |

| | | | | | 91 |
|-----------------------------|------------------|----------------|---------------|--------------|------------------|
| 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 8,359,071.97 | - | - | - | 8,359,071.97 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 6,359.39 | - | - | - | 6,359.39 |
| 交易性金融资产 | 1,273,008,177.01 | 225,204,653.15 | 20,671,473.98 | - | 1,518,884,304.14 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - |
| 其他债权投资 | - | - | - | - | - |
| 其他权益工具投资 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 4,153,580.14 | 4,153,580.14 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,281,373,608.37 | 225,204,653.15 | 20,671,473.98 | 4,153,580.14 | 1,531,403,315.64 |
| 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 | 256,912,474.03 | - | - | - | 256,912,474.03 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 333,729.41 | 333,729.41 |
| 应付托管费 | - | - | - | 111,243.14 | 111,243.14 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 88,114.77 | 88,114.77 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 131,987.87 | 131,987.87 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 261,623.97 | 261,623.97 |

| | | | | | |
|---------|------------------|----------------|---------------|--------------|------------------|
| 负债总计 | 256,912,474.03 | - | - | 926,699.16 | 257,839,173.19 |
| 利率敏感度缺口 | 1,024,461,134.34 | 225,204,653.15 | 20,671,473.98 | 3,226,880.98 | 1,273,564,142.45 |

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| | 市场利率上升 25bp | -3,098,007.90 | -2,336,598.44 |
| | 市场利率下降 25bp | 3,119,452.26 | 2,354,338.77 |

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 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 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 | 1,596,773.86 0.33 | 122.64 | 1,518,725,004 .95 | 119.26 |
| 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 | 1,596,773.86 0.33 | 122.64 | 1,518,725,004 .95 | 119.26 |

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 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次 | - |
| 第二层次 | 1,596,773,860.33 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 1,596,773,860.33 |

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 2023 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

无

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 | 1,596,773,860.33 | 98.11 |
| | 其中：债券 | 1,596,773,860.33 | 98.11 |
| | 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 | 12,413,842.44 | 0.76 |
| 8 | 其他各项资产 | 18,302,271.91 | 1.12 |
| 9 | 合计 | 1,627,489,974.68 | 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 | 252,805,105.58 | 19.42 |
| | 其中：政策性金融债 | 192,648,436.72 | 14.80 |
| 4 | 企业债券 | 41,361,173.29 | 3.18 |
| 5 | 企业短期融资券 | 485,980,606.94 | 37.33 |
| 6 | 中期票据 | 816,626,974.52 | 62.72 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |

| | | | |
|----|------|------------------|--------|
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,596,773,860.33 | 122.64 |

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 | 230201 | 23 国开 01 | 700,000 | 70,679,095.63 | 5.43 |
| 2 | 210406 | 21 农发 06 | 500,000 | 51,628,835.62 | 3.97 |
| 3 | 012381526 | 23 华银电力 SCP001 | 500,000 | 50,274,311.48 | 3.86 |
| 4 | 092318003 | 23 农发清发 03 | 500,000 | 49,991,325.14 | 3.84 |
| 5 | 102101011 | 21 国家能源 MTN001 | 400,000 | 40,389,245.90 | 3.10 |

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1、“23 农业银行三农债”发行人中国农业银行股份有限公司，因理财业务存在违法违规行为，被处以罚款 150 万元。（银保监罚决字〔2022〕52 号，2022 年 9 月 30 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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 1,037.37 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 18,301,234.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 18,302,271.91 |

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 | 23,840 | 38,263.36 | 776,817,705.82 | 85.16% | 135,380,879.16 | 14.84% |
| 新华鑫日享中短债债券 C | 4,487 | 29,158.99 | 49,309,760.64 | 37.69% | 81,526,643.43 | 62.31% |
| 新华鑫日享中短债债券 B | 20,195 | 10,328.79 | 0.00 | 0.00% | 208,589,922.60 | 100.00% |
| 合计 | 48,522 | 25,795.00 | 826,127,466.46 | 66.00% | 425,497,445.19 | 34.00% |

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 | 新华鑫日享中短债债券 A | 1,818.95 | 0.00% |
| | 新华鑫日享中短债债券 C | 779,967.76 | 0.60% |

| | | | |
|--|-----------------|------------|-------|
| | 新华鑫日享中短债债券 B | 1,358.86 | 0.00% |
| | 合计 | 783,145.57 | 0.06% |

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 | 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 |
| 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 | 932,602,151.85 | 53,040,722.92 | 260,015,466.18 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,105,143,580.46 | 256,878,856.28 | 73,438,783.68 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,125,547,147.33 | 179,083,175.13 | 124,864,327.26 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 912,198,584.98 | 130,836,404.07 | 208,589,922.60 |

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

2023 年 2 月 28 日，翟晨曦女士离任公司董事长，于春玲女士代任公司董事长，刘征宇先生由于个人原因不再担任副总经理。2023 年 3 月 23 日，崔凤廷先生担任公司副总经理。2023 年 4 月，公司法定代表人变更为于春玲女士。2023 年 6 月 28 日，于春玲女士担任公司董事长、代任总经理，张宗友先生离任公司联席董事长，崔凤廷先生担任公司董事会秘书。

本报告期因第二届董事会任期届满，经公司 2023 年第二次股东大会审议通过，选举于春玲女士、张宗友先生、李磊先生、匡双礼先生、张坤女士、徐经长先生担任公司第三届董事会董事，其中匡双礼先生、张坤女士、徐经长先生为独立董事。卢东亮先生担任非职工监事，王建岭先生、孙义女士担任职工监事。2023 年 7 月 20 日，卢东亮先生担任监事会主席。

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

本报告期基金管理人与原深圳办公区所租房屋的房东黄淑娴与二房东（承租人）之间存在房屋占用费的纠纷案件，该案件二审判决作出，管理人需支付房屋使用费，二房东收取的房租应当退回。基金管理人专户产品众富 1 号交易对手湖北蕲春农商行对公司发起诉讼，目前该案件已申请撤诉。

本报告期内，无涉及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

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

10.7.2 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，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》（证监基字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用2个交易席位，其中报告期内新增0个交易席位，退租0个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

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

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|------|--------------|------------------|------|------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总 额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总 额的比例 |
| 光大证券 | 8,067,090.42 | 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部分基金增加国金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 | 上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2023-01-18 |
| 2 | 新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2022 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 | 2023-01-20 |
| 3 | 新华鑫日享中短债债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告 | 公司网站、电子信披网站 | 2023-01-20 |
| 4 | 新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告 | 中国证券报、公司网站、电子信披网站 | 2023-02-08 |
| 5 | 新华基金管理股份有限公司关于调整新华鑫日享中短债债券型证券投资基金最低赎回份额及最低持有份额数额限制的公告 | 证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2023-02-10 |
| 6 | 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海通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 | 2023-02-10 |
| 7 | 新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台及网上直销交易优惠费率的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2023-02-15 |
| 8 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华瑞保险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 | 2023-02-21 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------------|------------|
| 9 | 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 | 2023-03-02 |
| 10 | 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 | 2023-03-02 |
| 11 | 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 | 2023-03-24 |
| 12 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加济安财富（北京）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 | 2023-03-27 |
| 13 | 新华基金管理股份有限公司旗下基金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 | 2023-03-30 |
| 14 | 新华基金管理股份有限公司关于开展新华鑫日享中短债债券型证券投资基金 B 类份额销售服务费优惠活动的公告 | 证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2023-03-30 |
| 15 | 新华鑫日享中短债债券型证券投资基金 2022 年年度报告 | 公司网站、电子信披网站 | 2023-03-30 |
| 16 | 新华基金管理股份有限公司关于上海好买基金销售有限公司暂停销售新华鑫日享中短债债券型证券投资基金 C 类份额，新增销售新华鑫日享中短债债券型证券投资基金 B 类份额的公告 | 证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2023-04-20 |
| 17 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金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 | 2023-04-21 |
| 18 | 新华鑫日享中短债债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | 公司网站、电子信披网站 | 2023-04-21 |
| 19 | 新华基金管理股份有限公司关于公司法定代表人变更的公告 | 中国证券报、公司网站、电子信披网站 | 2023-04-25 |
| 20 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广基金销售有限公司为代销机构的公告 | 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 | 2023-06-29 |
| 21 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告 | 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 | 2023-06-30 |
| 22 | 新华基金管理股份有限公司关于公司董事变更的公告 | 中国证券报、公司网站、电子信披网站 | 2023-06-30 |
| 23 | 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 | 2023-06-30 |
| 24 | 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 | 2023-06-30 |
| 25 | 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 | 2023-06-30 |

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 | 20230310-20230630 | - | 387,633,491.62 | - | 387,633,491.62 | 30.97% |
| | 2 | 20230105-20230108, 20230110-20230112, 20230117-20230118, 20230120-20230309 | 247,407,697.17 | - | 96,024,583.00 | 151,383,114.17 | 12.09% |

产品特有风险

- 1、本基金为纯债债券型基金，债券的投资比例不低于基金资产的 80%，且主要投资于中短债主题证券，中短债主题证券是指剩余期限不超过三年的债券资产，该类债券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。债券的投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、货币政策、市场需求变化、行业波动等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个券价格表现低于预期的风险。
- 2、本基金投资于中小企业私募债券所面临的信用风险及流动性风险。信用风险主要是由目前国内中小企业的发展状况所导致的发行人违约、不按时偿付本金或利息的风险；流动性风险主要是由债券非公开发行和转让所导致的无法按照合理的价格及时变现的风险。由于中小企业私募债券的特殊性，本基金的总体风险将有所提高。
- 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、基金合同提前终止的风险：如出现《基金合同》第五部分第三条约定的资产规模过小、基金份额持有人人数较少等情形的，《基金合同》将终止。

11.2 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

二〇二三年八月三十日