

# 新沃通宝货币市场基金 2016 年半年度报告 摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十五日

## § 1 重要提示

### 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。本半年度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 2016 年 8 月 23 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	新沃通宝
基金主代码	001916
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 10 月 20 日
基金管理人	新沃基金管理有限公司
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	998,419,559.58 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险、保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。具体而言，本基金主要通过利率策略、骑乘策略、放大策略、信用债投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### 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		新沃基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈阳	罗菲菲
	联系电话	400-698-9988	010-58560666
	电子邮箱	service@sinvofund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-698-9988	95568
传真		010-58290500	010-58560798

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.sinvofund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## § 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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	7,342,645.76
本期利润	7,342,645.76
本期净值收益率	1.1136%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	998,419,559.58
期末基金份额净值	1.0000

注：1、本基金合同生效日为2015年10月20日，主要财务指标的计算期间为2016年1月1日至2016年6月30日。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零。本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金收益分配按日结转份额。

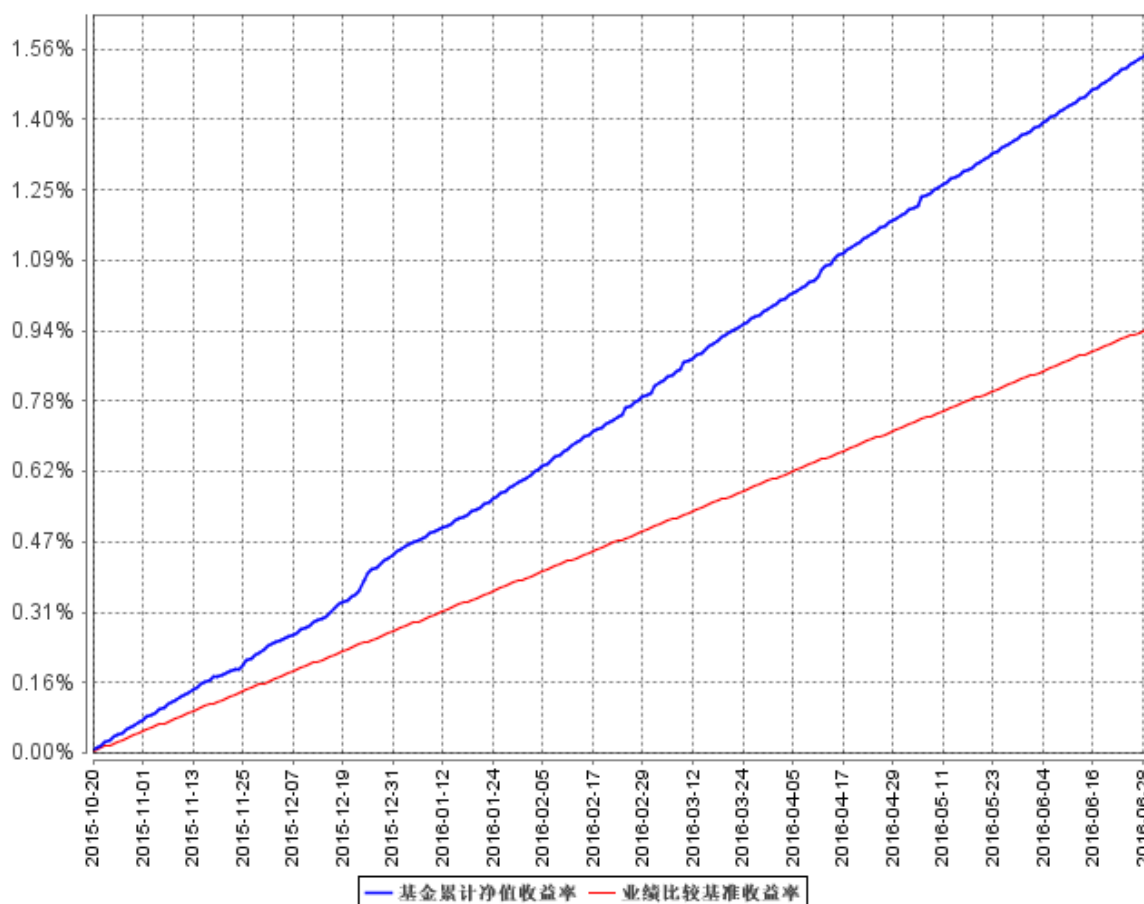
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.1820%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.0710%	0.0004%
过去三个月	0.5625%	0.0019%	0.3366%	0.0000%	0.2259%	0.0019%
过去六个月	1.1136%	0.0019%	0.6732%	0.0000%	0.4404%	0.0019%
自基金合同生效起至今	1.5579%	0.0023%	0.9432%	0.0000%	0.6147%	0.0023%

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

基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2015 年 10 月 20 日生效，基金合同生效起至本报告期末未满一年。

2、本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

## § 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

新沃基金管理有限公司成立于 2015 年 8 月，是一家经中国证监会核准设立的全国性基金管理公司，注册资本 10,000 万元，具有基金管理资格，经营基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

公司成立以来，公募基金和特定客户资产管理业务均得到较快发展。公司于 2015 年成功发行了新沃通宝货币市场基金，投资业绩稳步上升，以良好的投资回报实现了投资人资产的保值增值。

公司特定客户资产管理业务平稳起航，与部分商业银行、证券公司、私募基金等机构进行了广泛的业务合作。除传统业务外，公司还十分重视创新业务的开发，公司已与多家互联网公司、第三方支付公司、大型企业集团等开展合作或建立了合作意向，为客户提供余额理财等资产管理服务。

公司秉承“专业创造机会，合作实现价值”的发展理念，坚持“以人为本”的发展战略，坚守“诚信、专业、合作、超越”的价值准则，致力于经过长期努力跻身国内一流基金管理公司行列，拥有顶级的团队、最具影响力的品牌、最为稳定优秀的业绩，使资产管理规模进入业内前列。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
李丹	本基金的 基金经理	2015年11月 16日	-	5年	中国人民银行研究生部硕士，中国籍。2010年7月至2015年8月任职于中银保险北京总公司，历任债券交易员、债券研究员、固定收益投资经理等职。2015年8月加入新沃基金管理有限公司。
易卓	本基金的 基金经理	2015年10月 20日	2016年6月 20日	7年	经济学博士，中国籍。曾先后担任加拿大西门菲莎大学经济学讲师、财富证券研究与发展中心首席策略分析师与部门主管、新沃资本控股集团证券投资部总经理、新沃基金管理有限公司投资研究部总经理。

注：1、任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

## 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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 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

本基金运行期间，经济基本面维持低位震荡，国内经济在经历了一季度由地产带动的强劲反弹后，二季度进入温和复苏加财政托底阶段。受基数效应影响 5 月 CPI 回落，通胀压力暂缓，PPI 持续改善有利于工业企业利润的改善。上半年资金面总体维持平稳，仅在季末半年末或缴税缴准等个别时点紧张，央行开始采用 SLF、MLF、OMO 等周期化、碎片化的中性对冲的货币政策抚平资金利率的大幅波动。人民币汇率市场化继续推进中，6 月英国意外脱欧，美国加息延后，人民币将继续小幅贬值态势，大幅贬值可能性不大。上半年因托底实体经济，4 月开始利率债承压，利率开始反弹，同时由于营改增、信用违约频发，利率债和信用债齐跌。直到 5 月营改增补丁出台，城投提前偿还取消、铁物资风波得到后续处理，债市恐慌情绪才有所缓解，利率债收益率也较此前小幅下行。6 月中旬，随着美国加息延迟、英国脱欧带来避险情绪上升，国债、国开债利率开始下行，且长端下行幅度大于短端，但仍未到年初低位。本基金在债券利率短期调整时把握时机抓紧加仓利率债，并在季末半年末资金利率高企时点增加存款和逆回购的操作，收益有了明显提升。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期份额净值收益率为 1.1136%，同期业绩比较基准收益率为 0.6732%。

## 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，经济将继续低位震荡，稳增长和供给侧改革继续并存，通胀压力不大，维持在 2%左右，去产能的逐步落实有利于经济可持续发展，并支撑 PPI 复苏。稳健的货币政策和积极的财政政策将持续，资金面将继续维持紧平衡，积极的财政政策有利于信用扩张。下半年债券到期

量较大，过剩产业再融资压力大，债市要警惕来自基本面企稳、资金面紧平衡、信用风险爆发、监管去债市杠杆等多方面的压力，但羸弱的基本面支撑债市调整幅度不会过大。本基金管理人将在深入研究的基础上，根据市场的变化及时、灵活地调整资产配置及久期分布，加强组合的流动性及信用风险管理，力争在风险可控的前提下为投资者创造稳定、理想的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，为建立健全有效的估值政策和程序，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由投资研究部、监察稽核部、基金事务部相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

(3) 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

(4) 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同有关规定：本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本基金在本半年度累计分配收益 7,342,645.76 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 7,416,700.72 元，计入应付收益科目



-74,054.96 元。

#### **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**

本基金本报告期未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### **§ 5 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，本基金托管人在对新沃通宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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，本托管人对本基金管理人一新沃基金管理有限公司在新沃通宝货币市场基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金利润分配、基金费用开支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，在各方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新沃通宝货币市场基金实施利润分配的金额为 7,342,645.76 元。

#### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

由新沃通宝货币市场基金的基金管理人一新沃基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、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：新沃通宝货币市场基金

报告截止日： 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		31,579,938.90	1,191,195,202.46
结算备付金		-	235,048,500.05
存出保证金		-	-
交易性金融资产		658,775,288.24	19,991,825.86
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		658,775,288.24	19,991,825.86
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		306,001,099.00	800,002,680.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		2,594,017.86	929,470.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		998,950,344.00	2,247,167,678.93
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		195,256.84	124,667.89
应付托管费		29,584.34	18,889.06
应付销售服务费		147,921.83	94,445.37
应付交易费用		15,669.52	10,365.07
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		68,707.31	142,762.27
递延所得税负债		-	-
其他负债		73,644.58	50,000.00
负债合计		530,784.42	441,129.66
<b>所有者权益：</b>			

实收基金		998,419,559.58	2,246,726,549.27
未分配利润		-	-
所有者权益合计		998,419,559.58	2,246,726,549.27
负债和所有者权益总计		998,950,344.00	2,247,167,678.93

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 998,419,559.58 份。

## 6.2 利润表

会计主体：新沃通宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
<b>一、收入</b>			9,637,664.17
1.利息收入			9,226,006.46
其中：存款利息收入			1,352,193.32
债券利息收入			6,101,260.46
资产支持证券利息收入			-
买入返售金融资产收入			1,772,552.68
其他利息收入			-
2.投资收益（损失以“-”填列）			411,657.71
其中：股票投资收益			-
基金投资收益			-
债券投资收益			411,657.71
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）			-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）			-
5.其他收入（损失以“-”号填列）			-
<b>减：二、费用</b>			2,295,018.41
1. 管理人报酬			1,102,175.02
2. 托管费			166,996.21
3. 销售服务费	6.4.8.2.3		834,981.01
4. 交易费用			-
5. 利息支出			89,987.06
其中：卖出回购金融资产支出			89,987.06
6. 其他费用			100,879.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>			<b>7,342,645.76</b>

号填列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,342,645.76

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新沃通宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,246,726,549.27	-	2,246,726,549.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	7,342,645.76	7,342,645.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,248,306,989.69	-	-1,248,306,989.69
其中：1.基金申购款	1,553,044,987.91	-	1,553,044,987.91
2.基金赎回款	-2,801,351,977.60	-	-2,801,351,977.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-7,342,645.76	-7,342,645.76
五、期末所有者权益（基金净值）	998,419,559.58	-	998,419,559.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

      库三七        
基金管理人负责人

      王靖飞        
主管会计工作负责人

      马楠        
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

新沃通宝货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2253 号《关于准予新沃通宝货币市场基金注册的批复》核准,由新沃基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃通宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 200,063,654.31 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1153 号予以验证。经向中国证监会备案,《新沃通宝货币市场基金基金合同》于 2015 年 10 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,063,654.31 份基金份额,本基金募集期间有效认购参与款项未产生需要折算为基金份额的利息。本基金的基金管理人为新沃基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《新沃通宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行存款和大额存单、剩余期限在 397 天(含 397 天)以内的债券和中期票据、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、短期融资券(含超短期融资券)、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款税后利率。

本财务报表由本基金的基金管理人新沃基金管理有限公司于 2016 年 8 月 25 日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“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<年度报告和半年度报告>》、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》、《新沃通宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日止期间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 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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

无。

##### 6.4.7.2 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
新沃基金管理有限公司（“新沃基金”）	基金管理人、注册登记机构和基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金托管人
新沃联合资产管理有限公司	基金管理人的股东
新沃资本控股集团有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.8.1.1 股票交易**

无。

**6.4.8.1.2 债券交易**

无。

**6.4.8.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.8.1.4 权证交易**

无。

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.8.2 关联方报酬****6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,102,175.02
其中：支付销售机构的客户维护费	25,689.57

注：支付基金管理人新沃基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，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 X0.33%/当年天数。

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	166,996.21

注：支付基金托管人民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.05%/当年天数。

**6.4.8.2.3 销售服务费**

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
新沃基金管理有限公司	779,990.39	
合计	779,990.39	

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给新沃基金，再由新沃基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

**6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 10 月 20 日）持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	55,007,798.70
期间申购/买入总份额	517,699.58
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	27,400,035.00
期末持有的基金份额	28,125,463.28
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.82%

注：1、期间申购总份额含红利再投份额。

2、基金管理人新沃基金在本年度申购本基金的交易委托新沃基金管理有限公司直销中心办理，无申购费。

**6.4.8.4.2 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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例



新沃联合资产管理 有限公司	0.08	0.00%	2,500,161.63	0.11%
新沃资本控股集团 有限公司	68,208,626.23	6.83%	100,013,408.03	4.45%

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行-活期存款	1,579,938.90	25,302.45
中国民生银行-定期存款	30,000,000.00	193,527.64

注：本基金的活期存款和部分定期存款由基金托管人中国民生银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	固定收益投资	658,775,288.24	65.95
	其中: 债券	658,775,288.24	65.95
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	306,001,099.00	30.63
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	31,579,938.90	3.16
4	其他各项资产	2,594,017.86	0.26
5	合计	998,950,344.00	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.24	
	其中: 买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	2

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余期限违规超过 120 天的情形。

#### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	61.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	11.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	3.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	5.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	17.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.79	-

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过 240 天的情形。

### 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	29,968,160.01	3.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,374,139.01	2.04
	其中：政策性金融债	20,374,139.01	2.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	140,148,449.53	14.04
6	中期票据	-	-
7	同业存单	468,284,539.69	46.90

8	其他	-	-
9	合计	658,775,288.24	65.98
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

## 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111610254	16 兴业 CD254	400,000	39,538,652.49	3.96
2	041556034	15 新中泰集 CP002	300,000	30,036,089.94	3.01
3	169903	16 贴现国债 03	300,000	29,968,160.01	3.00
4	041664002	16 武清国资 CP001	200,000	20,030,368.65	2.01
5	041660005	16 鄂西圈 CP001	200,000	20,027,202.30	2.01
6	011699215	16 沪华信 SCP001	200,000	20,022,053.90	2.01
7	011515010	15 中铝业 SCP010	200,000	20,016,164.66	2.00
8	111694005	16 贵州花溪农商行 CD035	200,000	20,000,000.00	2.00
9	111694026	16 苏州银行 CD064	200,000	19,998,336.66	2.00
10	111694057	16 浙江泰隆商行 CD022	200,000	19,996,664.10	2.00

## 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1309%
报告期内偏离度的最低值	-0.0688%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0452%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未发现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

**7.9.1** 本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

**7.9.2** 报告期内，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,594,017.86
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,594,017.86

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告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

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
1,057	944,578.58	995,044,001.61	99.66%	3,375,557.97	0.34%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	867,860.97	0.09%

### 8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年10月20日）基金份额总额	200,063,654.31
本报告期期初基金份额总额	2,246,726,549.27
本报告期基金总申购份额	1,553,044,987.91
减：本报告期基金总赎回份额	2,801,351,977.60
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	998,419,559.58

注：表内“总申购份额”含红利再投份额。

## § 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

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
方正证券	2	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《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）的规定及《新沃基金管理有限公司交易席位管理办法》，本基金管理人制定了券商选择标准和租用交易单元的程序，具体如下：

投资研究部按照《券商评估细则》完成对各往来证券经纪商的评估，评估实行评分制：分配权重（100分）=基础服务（45%）+特别服务（45%）+销售服务（10%）。

基础服务占 45%权重，由研究员负责打分；特别服务占 45%权重，由投资研究部负责人和研究员共同打分；销售服务占 10%权重，由投资研究部负责人打分。

基础服务包括：报告、电话沟通、路演、联合调研服务等；

特别服务包括：深度推荐公司、单独调研、带上市公司上门路演、约见专家、委托课题、人员培养、重大投资机会等；

销售服务包括：日常沟通、重点推荐的沟通、研究投资工作的支持和配合。

根据以上标准对券商进行评估、确定选用交易单元的券商后，本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租赁协议，并通知基金托管人。

2、本报告期内租用的证券公司交易单元未发生变更情况，仍然租用方正证券上海席位（席位号 34786）和深圳席位（席位号 000293）。

### 10.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
方正证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

新沃基金管理有限公司

2016 年 8 月 25 日