

# 新沃通宝货币市场基金 2016 年第 3 季度 报告

2016 年 9 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

报告送出日期：二〇一六年十月二十六日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	新沃通宝	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	1,115,105,088.29 份	
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。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，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	新沃通宝 A	新沃通宝 B
下属分级基金的交易代码	001916	002302
报告期末下属分级基金的份额总额	28,951,808.04 份	1,086,153,280.25 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月30日）	
	新沃通宝 A	新沃通宝 B
1. 本期已实现收益	1,540,769.00	2,853,817.94
2. 本期利润	1,540,769.00	2,853,817.94
3. 期末基金资产净值	28,951,808.04	1,086,153,280.25

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，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。

2、本基金 B 类份额生效日期为 2016 年 8 月 5 日。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

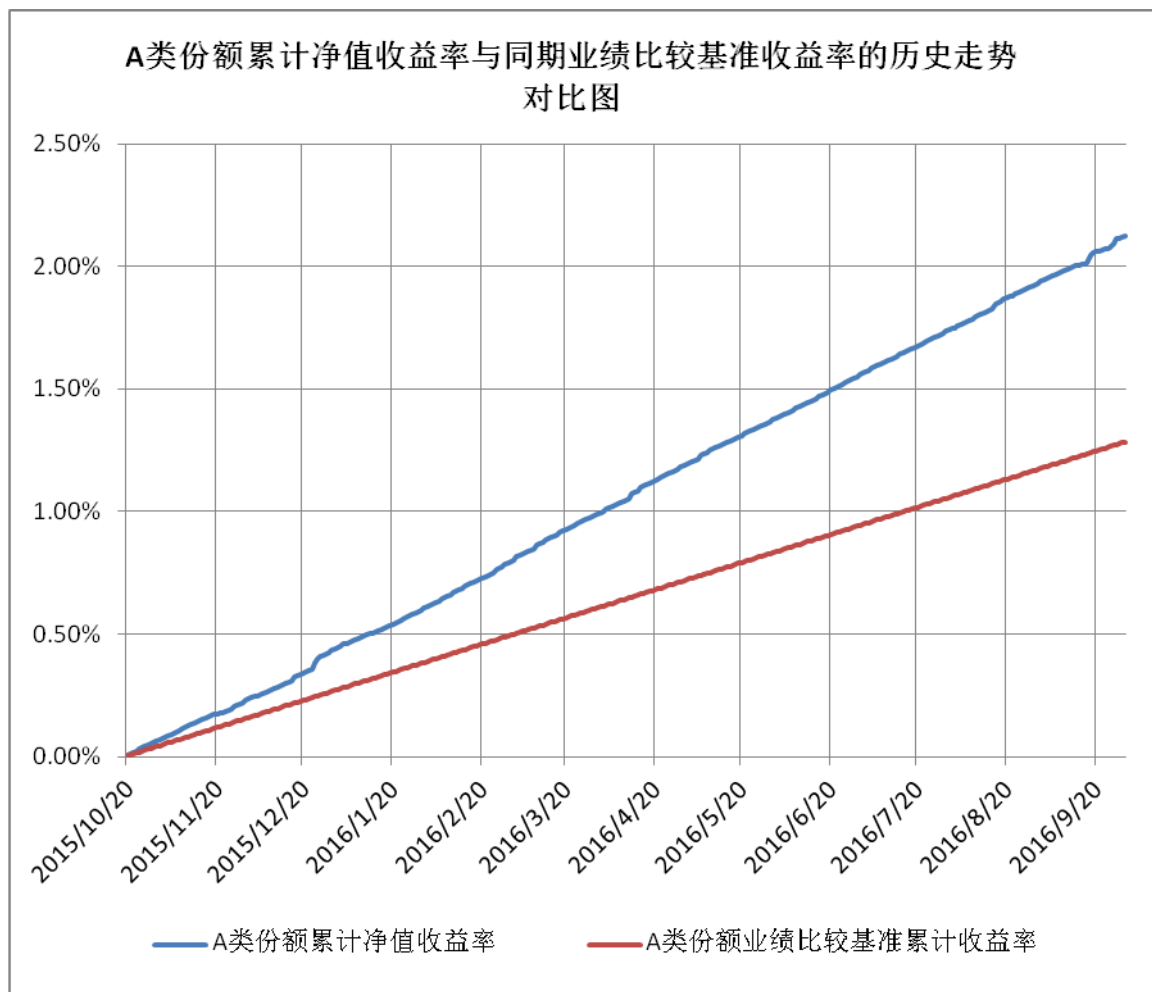
###### 新沃通宝 A

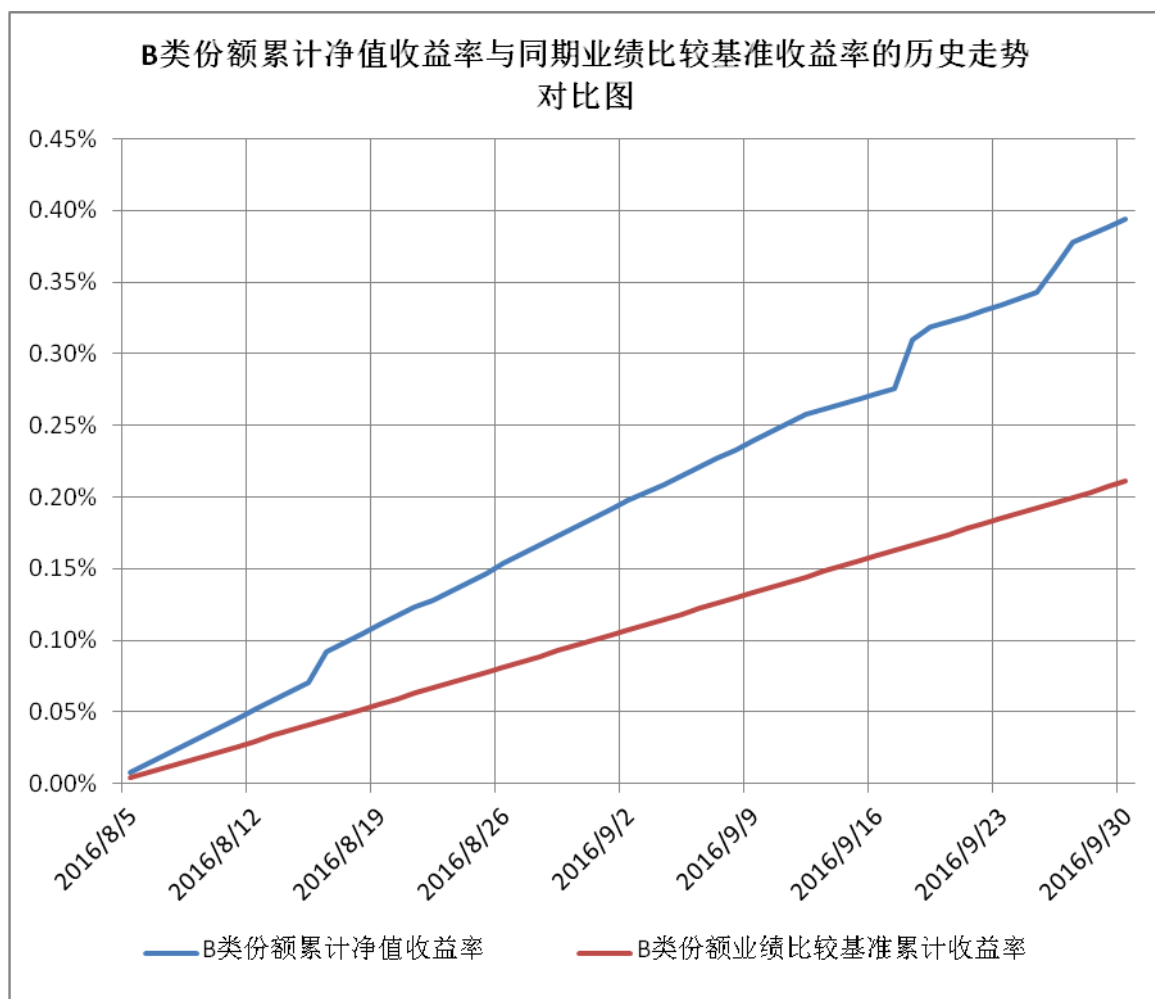
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5588%	0.0039%	0.3403%	0.0000%	0.2185%	0.0039%

###### 新沃通宝 B

阶段	净值收益率①	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
2016年8月5日(B类份额生效日)至2016年9月30日	0.3943%	0.0049%	0.2108%	0.0000%	0.1835%	0.0049%

### 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





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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。

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合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

##### 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。

本报告期内，未出现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交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年三季度，经济增长数据低位徘徊，固定资产投资数据下行，CPI 保持在 2 以下的低位，基本面对债市形成支撑。资金面方面，六月底刚过资金利率就快速下行，但由于货币政策逐步趋稳，14 天和 28 天逆回购的启用提高了市场的资金成本，八月中旬开始资金利率不断上行，一直持续到九月底达到顶点。利率债方面，从各期限国债收益率走势看，7 月初至 8 月中旬各期限利率延续二季度下降趋势，8 月中旬以来随着央行超常规公开市场操作，杠杆交易的利差空间变小，导致了利率反弹收益率有所反弹。期限利差先增后减，总体较二季度末有所回升。信用债方面，受到利率债基准利率下行影响，产能过剩行业债券前期过度悲观的情绪得以修复，三季度的前半段信用利差大幅下行，一些产能过剩行业行业利差也经历了鲜有的系统性下行，8 月份开始基准利率上行的背景下信用利差略有反弹，高等级、短期限品种受流动性因素制约随后反弹较多，而低等级、中长期债券反弹较少，主要源于“资产荒”下中低等级信用债中“估值洼地”被配置需求填平。三季度，本基金在债券利率短期调整时把握时机抓紧加仓短融，在后期获利后逐步卖出部分短融释放利润，并在资金利率高企时点提高存单配置量和逆回购的操作，保证基金收益

率中高位稳定态势。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金 A 类份额净值收益率为 0.5588%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；本基金 B 类份额净值收益率为 0.3943%，同期业绩比较基准收益率为 0.2108%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	718,468,475.67	64.41
	其中：债券	718,468,475.67	64.41
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	386,001,539.00	34.60
	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	6,321,414.14	0.57
4	其他资产	4,747,414.02	0.43
5	合计	1,115,538,842.83	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

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	2.17	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	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%。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 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	83
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

#### 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超过 120 天的情形。

#### 5.3.2 报告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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	56.69	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	12.55	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	1.78	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	2.68	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	25.92	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.61	-

#### 5.4 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存续期超过 240 天的情形。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,511,883.61	6.32
	其中: 政策性金融债	70,511,883.61	6.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	260,595,546.43	23.37
6	中期票据	-	-
7	同业存单	387,361,045.63	34.74
8	其他	-	-



9	合计	718,468,475.67	64.43
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。

### 5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	011699027	16 新华联控 SCP001	500,000	50,085,038.89	4.49
2	041653056	16 胜通 CP001	400,000	40,125,424.64	3.60
3	150417	15 农发 17	300,000	30,270,702.57	2.71
4	011699738	16 鲁钢铁 SCP003	300,000	30,239,711.37	2.71
5	041560104	15 中铝国际 CP002	300,000	30,150,935.74	2.70
6	011698531	16 鲁钢铁 SCP005	300,000	29,982,280.49	2.69
7	111692817	16 稠州银行 CD014	300,000	29,465,677.70	2.64
8	041660005	16 鄂西圈 CP001	200,000	20,014,980.43	1.79
9	011699215	16 沪华信 SCP001	200,000	20,007,161.75	1.79
10	111697204	16 中原银行 CD095	200,000	19,988,091.58	1.79

### 5.7 “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	0.1279%
报告期内偏离度的最低值	0.0345%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0955%

#### 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。

### 5.8 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。

## 5.9 投资组合报告附注

**5.9.1** 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。

**5.9.2** 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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,746,413.89
4	应收申购款	1,000.13
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,747,414.02

### 5.9.4 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新沃通宝 A	新沃通宝 B
报告期期初基金份额总额	998,419,559.58	-
报告期期间基金总申购份额	742,300,558.47	2,023,993,951.52
报告期期间基金总赎回份额	1,711,768,310.01	937,840,671.27
报告期期末基金份额总额	28,951,808.04	1,086,153,280.25

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2016年7月13日	50.00	50.00	-
2	赎回	2016年7月15日	-2.00	-2.00	-
3	赎回	2016年7月20日	-1,500,000.00	-1,500,000.00	-
4	赎回	2016年7月26日	-1,000,000.00	-1,000,000.00	-
5	申购	2016年7月29日	20,000,000.00	20,000,000.00	-

6	分红再投资	-	231,916.49	231,916.49	-
合计			17,731,964.49	17,731,964.49	

注：本基金的收益分配按日结转份额，列示在“红利再投资”项下一并披露。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《新沃通宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《新沃通宝货币市场基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 8.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的办公场所。

### 8.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

新沃基金管理有限公司  
2016年10月26日