

新沃通宝货币市场基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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：二〇一七年三月三十一日

§ 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 2017 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§ 4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 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.....	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	27
§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 债券回购融资情况.....	52
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	53
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
8.6 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.....	54
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	55

8.8 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	55
8.9 投资组合报告附注	56
§ 9 基金份额持有人信息	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
9.3 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	57
§ 10 开放式基金份额变动	59
§ 11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
11.2 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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	61
11.9 其他重大事件	61
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新沃通宝货币市场基金	
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	4,368,856,860.85 份	
基金合同存续期	不定期	
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	98,675,064.28 份	4,270,181,796.57 份

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，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。

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		010-58290555	010-58560798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 2250 号 2 幢二层 C220 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		北京市海淀区丹棱街 3 号中国电子大厦 B 座 1616 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100080	100031
法定代表人		朱灿	洪崎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.sinvofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	新沃基金管理有限公司	北京市海淀区丹棱街 3 号中国电子大厦 B 座 1616 室

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年		2015 年 10 月 20 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	新沃通宝 A	新沃通宝 B	新沃通宝 A	新沃通宝 B
本期已实现收益	9,213,724.51	16,680,666.32	1,662,693.46	-
本期利润	9,213,724.51	16,680,666.32	1,662,693.46	-
本期净值收益率	2.3739%	1.1411%	0.4393%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
	期末基金资产净值	98,675,064.28	4,270,181,796.57	2,246,726,549.27
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末	
	累计净值收益率	2.8236%	1.1411%	0.4393%

注：1、本基金合同于 2015 年 10 月 20 日生效，截至报告期末，本基金合同生效未满三年。

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。

4、新沃通宝 B 成立于 2016 年 8 月 5 日，详见《关于新沃通宝货币市场基金增设 B 类基金份额并修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》。

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

新沃通宝 A

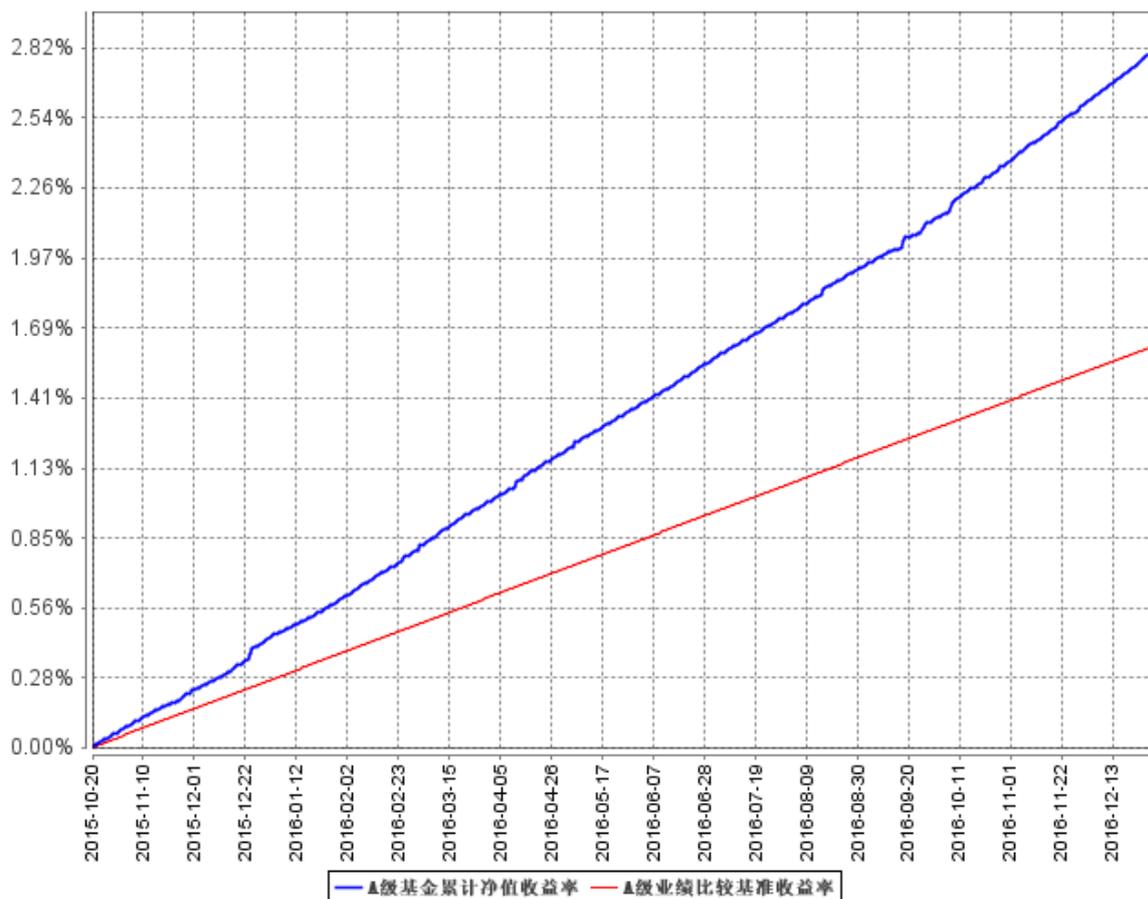
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6837%	0.0036%	0.3403%	0.0000%	0.3434%	0.0036%
过去六个月	1.2464%	0.0038%	0.6805%	0.0000%	0.5659%	0.0038%
过去一年	2.3739%	0.0030%	1.3537%	0.0000%	1.0202%	0.0030%
自基金合同 生效起至今	2.8236%	0.0031%	1.6237%	0.0000%	1.1999%	0.0031%

新沃通宝 B

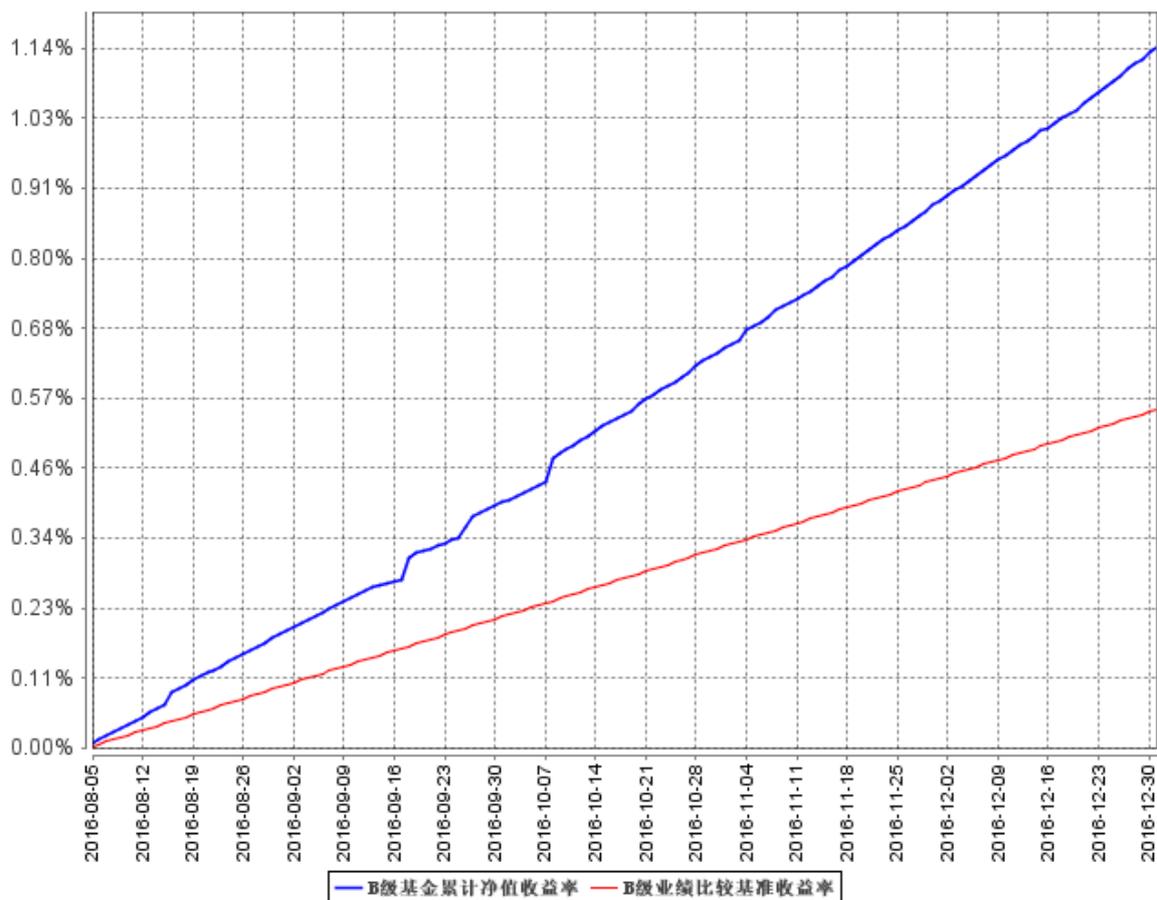
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7439%	0.0036%	0.3403%	0.0000%	0.4036%	0.0036%
自基金合同 生效起至今	1.1411%	0.0042%	0.5511%	0.0000%	0.5900%	0.0042%

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

A级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

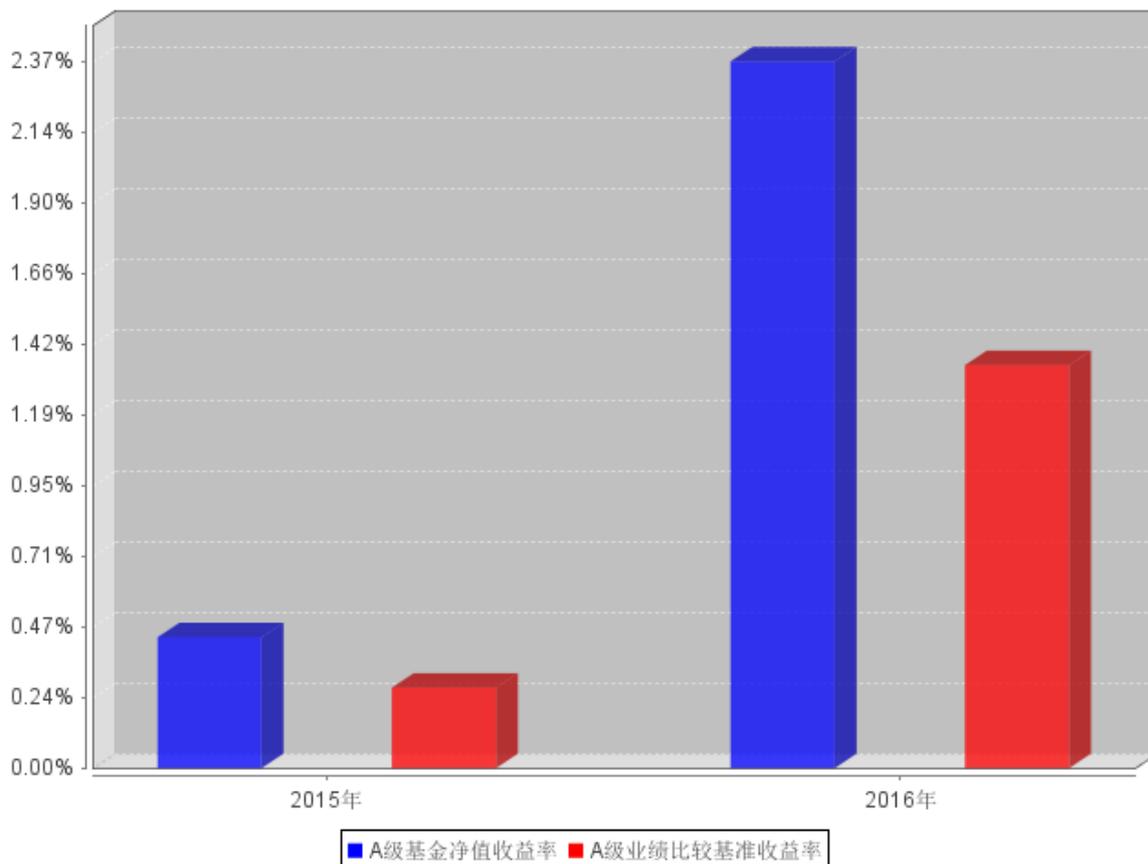


B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

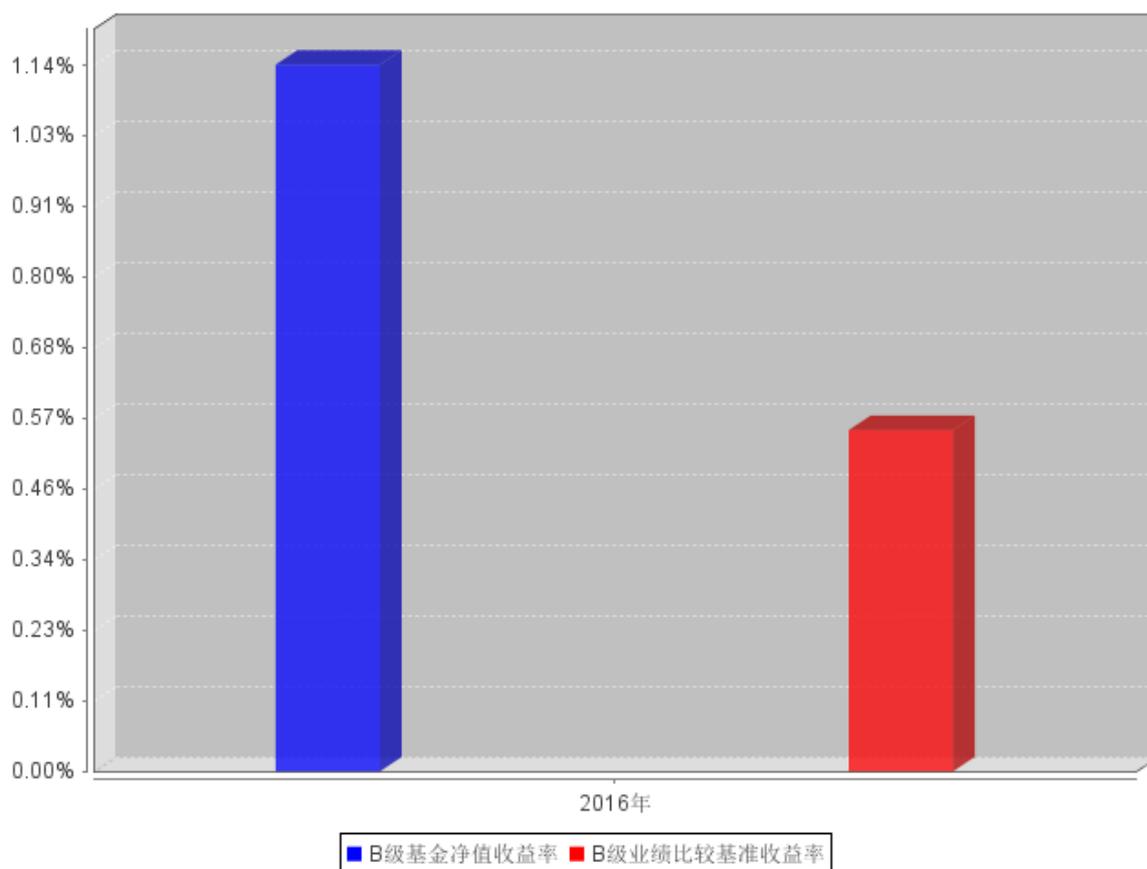


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

新沃通宝 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016	9,347,679.11	-	-133,954.60	9,213,724.51	
2015	1,519,931.19	-	142,762.27	1,662,693.46	
合计	10,867,610.30	-	8,807.67	10,876,417.97	

单位：人民币元

新沃通宝 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2016	16,271,514.10	-	409,152.22	16,680,666.32	
合计	16,271,514.10	-	409,152.22	16,680,666.32	

§ 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 年成立了新沃通宝货币市场基金，并于 2016 年成立了新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金、新沃通利纯债债券型证券投资基金和新沃鑫禧债券型证券投资基金，资产规模为 52.34 亿元人民币。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合。

未来，公司将继续秉承“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，力求为广大投资者提供稳定的投资回报。

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	2016 年 12 月 2 日	6 年	中国人民银行研究生部硕士，中国籍。曾先后担任中银保北京总公司债券交易员、债券研究员、固定收益投资经理，新沃基金管理有限公司基金经理。
俞璠	本基金的基金经理	2016 年 12 月 2 日	-	3 年	复旦大学硕士，中国籍。2013 年 7 月至 2016 年 9 月任职于国金证券，历任

					证券交易员、投资 经理、投资主办； 2016年10月加入新 沃基金。
--	--	--	--	--	---

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《新沃基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

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 2016 年上半年，美国经济数据喜忧参半，复苏前景仍存不确定性。货币政策超预期宽松；实体经济总体平稳，房地产投资增速改善，PMI 数据和其余高频数据显示经济确有回暖迹象，部分中观行业出现了复苏的迹象。整体经济基本面企稳和通胀抬头给了债券市场一定的上行压力，

引致一二级有所走弱。5 月宏观数据显示经济增速再现乏力状态，金融数据中社融和 M2 超预期回落触发了市场对下半年经济再度下行的预期，同时 CPI 重新回落缓和了通胀压力。下半年国内债券市场收益率也经历了一波下行，7 月份经济金融数据大幅弱于预期，关键期限利率债收益率全线下行。8 月经济金融数据呈现改善的趋势，市场对经济悲观预期有所修正，债券收益率出现了一波回调。第 4 季度，国内经济数据短期企稳，通胀回升。债券市场在国内经济基本面改善、流动性紧张、中美利差收窄等多因素影响下，自 10 月中下旬年内最低点开始大幅调整。12 月更遭遇了历史罕见的快速下跌，市场恐慌性抛售造成严重踩踏，国债期货出现了上市以来首次跌停，债市多日暴跌。随着央行加大投放力度并引导向非银机构融出，资金紧张状况得以改善，恐慌情绪逐渐缓解后债市止跌回升。

2016 年年末货币市场流动性持续紧张，同业存款、同业存单发行利率大幅上行，市场对监管层去杠杆的决心进一步担忧，叠加国海代持事件的发酵以及市场传闻某基金货币产品巨额亏损的消息，市场恐慌情绪蔓延，资金面多次出现紧张态势，资金价格飙升，12 月短端资产尤其存单收益率一路上行。随着证监会出面协调国海代持事件，央行向市场投放流动性并指导银行加大对非银机构的融出，市场恐慌情绪缓解，随着年末最后几天流动性的好转，债券收益率也有所修复。

报告期内，本基金管理人深入研究市场行情，密切跟踪市场动态变化，实施积极主动的组合投资，选择合适的介入机会，灵活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。本基金以同业存单、银行协议存款、短期融资券为主要配置资产，维持了组合中相对短的组合久期，并维持了较低的杠杆率，在保持收益率稳定的同时为投资者提供了较高的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，新沃通宝货币市场基金 A 级份额净值收益率 2.8236%，同期业绩比较基准收益率为 1.6237%；B 级份额净值收益率 1.1411%，同期业绩比较基准收益率为 0.5511%。

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 2017 年，在积极财政政策支持下，基建或将继续托底经济；制造业在企业盈利改善下小幅反弹，但在供给侧改革约束以及对经济前景预期不乐观的情况下，企业融资和投资需求并未改善。整体经济仍面临下行压力。物价方面，OPEC 和非 OPEC 减产推升油价上涨，供给侧改革推升钢铁、煤炭价格，PPI 预计在低基数下明年一季度将继续上行至高位；CPI 方面，在非食品价格走高的压力下，明年 CPI 中枢水平预计将小幅提升。政策面上，央行货币政策中性稳健的态度依然明确，银行间市场流动性环境仍将维持紧平衡状态。银行理财将于一季度正式纳入 MPA 考核，监管层防风险、去杠杆的监管思路将持续，短期债券和同业存单、同业存款利率难以回到此次市场调整前的低位，货币市场基金所能投资的资产将维持在较高收益，这将使货币基金所能获得的投

资收益保持在较好的水平。

本基金管理人将坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位，在保持投资组合较好流动性和安全性的前提下，根据投资者结构变化，结合市场形势，适时调整组合各类资产比例，保持适当的久期和杠杆比例，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。

基金管理人将坚持规范运作、审慎投资，勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人结合法律法规和业务发展需要，进一步修订、完善了公司的内部制度及流程；组织了多项合规培训，提高员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议；对基金的宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提升监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、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。

4.7.2 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。

4.7.3 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。

4.7.4 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 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。

本基金本年度累计分配收益 25,894,390.83 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 25,619,193.21 元，计入应付收益科目 275,197.62 元。

4.9 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

本基金报告期末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，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—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 25,894,390.83 元。

5.3 托管人对本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—新沃基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21142 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	新沃通宝货币市场基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的新沃通宝货币市场基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是新沃通宝货币市场基金的基金管理人新沃基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评</p>

	<p>估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	<p>我们认为，上述新沃通宝货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了新沃通宝货币市场基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度经营成果和基金净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	单峰	张勇
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	744,067,739.93	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	7.4.7.2	1,380,542,967.35	19,991,825.86
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,380,542,967.35	19,991,825.86
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,433,603,957.03	800,002,680.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	7,628,263.28	929,470.56
应收股利		-	-
应收申购款		0.11	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,565,842,927.70	2,247,167,678.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		194,940,587.58	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		792,826.86	124,667.89
应付托管费		120,125.28	18,889.06
应付销售服务费		34,875.64	94,445.37
应付交易费用	7.4.7.7	59,207.12	10,365.07
应交税费		-	-
应付利息		531,484.48	-
应付利润		417,959.89	142,762.27
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	89,000.00	50,000.00
负债合计		196,986,066.85	441,129.66
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,368,856,860.85	2,246,726,549.27
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		4,368,856,860.85	2,246,726,549.27
负债和所有者权益总计		4,565,842,927.70	2,247,167,678.93

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 4,368,856,860.85 份，其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 98,675,064.28 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 4,270,181,796.57 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年10月20日(基 金合同生效日)至 2015年12月31日
一、收入		31,992,511.55	2,102,036.86
1.利息收入		31,290,968.91	1,845,959.54
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,917,254.46	1,101,977.89
债券利息收入		17,885,836.11	251,989.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,487,878.34	491,969.21
其他利息收入		-	23.43
2.投资收益（损失以“-”填列）		601,542.64	256,077.32
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	601,542.64	256,077.32
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	100,000.00	-
减：二、费用		6,098,120.72	439,343.40
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,262,142.18	199,084.56
2. 托管费	7.4.10.2.2	494,264.02	30,164.30
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,111,602.64	150,821.61

4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		997,391.85	5,252.55
其中：卖出回购金融资产支出		997,391.85	5,252.55
6. 其他费用	7.4.7.20	232,720.03	54,020.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,894,390.83	1,662,693.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,894,390.83	1,662,693.46

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31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（本期利润）	-	25,894,390.83	25,894,390.83
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）	2,122,130,311.58	-	2,122,130,311.58
其中：1. 基金申购款	11,038,583,362.50	-	11,038,583,362.50
2. 基金赎回款	-8,916,453,050.92	-	-8,916,453,050.92
四、本期向基金份额持有	-	-25,894,390.83	-25,894,390.83

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	4,368,856,860.85	-	4,368,856,860.85
项目	上年度可比期间		
	2015年10月20日(基金合同生效日)至2015年12月31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）	200,063,654.31	-	200,063,654.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,662,693.46	1,662,693.46
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）	2,046,662,894.96	-	2,046,662,894.96
其中：1. 基金申购款	2,167,829,651.92	-	2,167,829,651.92
2. 基金赎回款	-121,166,756.96	-	-121,166,756.96
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）	-	-1,662,693.46	-1,662,693.46
五、期末所有者权益（基金净值）	2,246,726,549.27	-	2,246,726,549.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

库三七

基金管理人负责人

库三七

主管会计工作负责人

马楠

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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人民币 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《关于新沃通宝货币基金增设 B 类基金份额并修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》并报证监会备案,本基金于 2016 年 8 月 5 日起根据投资者持有基金份额数量的不同而形成不同的基金份额类别。在基金份额持有人在单个基金账户内持有的基金份额不超过 500 万份时,称为 A 类基金份额;超过 500 万份(含 500 万份)时,称为 B 类基金份额。本基金将设 A 类基金份额和 B 类基金份额,各类基金份额类别分别设置代码并分别计算和公告每万份基金已实现收益和七日年化收益率,且适用不同费率的销售服务费。自 2016 年 8 月 5 日起根据投资者基金账户所持有的基金份额数量,进行份额类别判断和处理。

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、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会、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 2017 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 10 月 20 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，并于下一自然日以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业

由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	64,067,739.93	1,195,202.46
定期存款	680,000,000.00	1,190,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	630,000,000.00	1,190,000,000.00
存款期限 3 个月以上	50,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计：	744,067,739.93	1,191,195,202.46

注：定期存款的存款期限指票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2016 年 12 月 31 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,380,542,967.35	1,378,100,000.00	-2,442,967.35	-0.0559%
	合计	1,380,542,967.35	1,378,100,000.00	-2,442,967.35	-0.0559%

项目		上年度末			
		2015 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	19,991,825.86	20,010,000.00	18,174.14	0.0008%
	合计	19,991,825.86	20,010,000.00	18,174.14	0.0008%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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	
	2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	1,438,023,957.03	-
买入返售证券_固定平台	995,580,000.00	-
合计	2,433,603,957.03	-
项目	上年度末	
	2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	800,002,680.00	-
合计	800,002,680.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,775.11	1,259.47
应收定期存款利息	399,861.00	496,177.07
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,923.19	18,024.09
应收债券利息	4,983,824.33	40,616.39
应收买入返售证券利息	2,231,879.65	373,393.54
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	7,628,263.28	929,470.56

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	59,207.12	10,365.07
合计	59,207.12	10,365.07

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	89,000.00	50,000.00
合计	89,000.00	50,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

新沃通宝 A		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,246,726,549.27	2,246,726,549.27
本期申购	2,598,447,621.53	2,598,447,621.53
本期赎回(以“-”号填列)	-4,746,499,106.52	-4,746,499,106.52
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	98,675,064.28	98,675,064.28

金额单位：人民币元

新沃通宝 B		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	8,440,135,740.97	8,440,135,740.97

本期赎回(以“-”号填列)	-4,169,953,944.40	-4,169,953,944.40
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,270,181,796.57	4,270,181,796.57

注：1. 申购含红利再投、级别调整入份额；赎回含级别调整出份额。

2. 根据《关于新沃通宝货币市场基金增设 B 类基金份额并修改基金合同、招募说明书和托管协议的公告》的相关规定，本基金于 2016 年 8 月 5 日起增加 B 类基金份额，并对本基金基金合同作相应修改。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

新沃通宝 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	9,213,724.51	-	9,213,724.51
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-9,213,724.51	-	-9,213,724.51
本期末	-	-	-

单位：人民币元

新沃通宝 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	16,680,666.32	-	16,680,666.32
本期基金份额交易	-	-	-

产生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-16,680,666.32	-	-16,680,666.32
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年10月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	55,451.82	3,322.54
定期存款利息收入	1,791,711.70	1,051,788.18
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	70,090.94	46,867.17
其他	-	-
合计	1,917,254.46	1,101,977.89

注：于 2016 年度，本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况（2015 年 10 月 20 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日：同）。

7.4.7.12 股票投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年10月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,481,997,712.54	130,484,458.70

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,470,725,152.74	129,888,746.41
减：应收利息总额	10,671,017.16	339,634.97
买卖债券差价收入	601,542.64	256,077.32

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

无。

7.4.7.16 公允价值变动收益

无。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年10月20日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他收入-违约金收入	100,000.00	-
合计	100,000.00	-

7.4.7.18 交易费用

无。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年10月20日(基金合同 生效日)至2015年12月31日

审计费用	80,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	10,000.00
账户服务费	39,000.00	-
银行费用	32,459.09	3,620.38
其他	1,260.94	400.00
合计	232,720.03	54,020.38

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

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(“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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年10月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,262,142.18	199,084.56
其中：支付销售机构的客户维护费	166,281.49	124.04

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×0.33%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年10月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	494,264.02	30,164.30

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×0.05%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----

各关联方名称	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新沃通宝 A	新沃通宝 B	合计
新沃基金管理有限公司	969,056.13	57,487.25	1,026,543.38
合计	969,056.13	57,487.25	1,026,543.38
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 10 月 20 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新沃通宝 A	新沃通宝 B	合计
新沃基金管理有限公司	150,586.51	-	150,586.51
合计	150,586.51	-	150,586.51

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的约定年费率计提，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。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 对应级别约定年费率 / 当年天数。

7.4.10.3 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						
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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
民生银行	39,788,192.61	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2015 年 10 月 20 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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
民生银行	9,998,423.50	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2016年1月1日至2016年12月31日	
	新沃通宝 A	新沃通宝 B
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	20,581,626.26	61,745,288.29
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	75,589,424.96	9,949,736.21
期末持有的基金份额	-	51,795,552.08
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.19%

项目	上年度可比期间 2015年10月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	新沃通宝 A	新沃通宝 B
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	-	-
期间申购/买入总份额	55,007,798.70	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	55,007,798.70	-

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.45%	-
-----------------------	-------	---

注：1、期间申购含红利再投、级别调整入份额；赎回含级别调整出份额。

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。

7.4.10.4.2 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

新沃通宝 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 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	-	-	2,500,161.63	0.11%
新沃资本控股 集团有限公司	-	-	100,013,408.03	4.45%

新沃通宝 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 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	8,100,640.76	0.19%	-	-
新沃资本控	97,253,058.75	2.28%	-	-

股集团有限 公司				
-------------	--	--	--	--

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年10月20日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行-活 期存款	64,067,739.93	55,451.82	1,195,202.46	3,322.54
民生银行-定 期存款	50,000,000.00	487,722.19	100,000,000.00	167,277.77

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

新沃通宝A

已按再投资形式转实收基 金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
9,347,679.11	-	-133,954.60	9,213,724.51	-

新沃通宝B

已按再投资形式转实收基 金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
16,271,514.10	-	409,152.22	16,680,666.32	-

注：本基金 A 级 001916 在本年度累计分配收益 9,213,724.51 元，其中以红利再投资方式结转入

实收基金 9,347,679.11 元(附注 7.4.7.9)，计入应付收益科目-133,945.60 元。

本基金 B 级 002302 在本年度累计分配收益 16,680,666.32 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 16,271,514.10 元(附注 7.4.7.9)，计入应付收益科目 409,152.22 元。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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 194,940,587.58 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总额
011698515	16 新中泰 集 SCP005	2017 年 1 月 3 日	99.98	100,000	9,998,070.77
011698335	16 中天科 技 SCP002	2017 年 1 月 3 日	99.99	100,000	9,998,939.81
011697004	16 首旅 SCP010	2017 年 1 月 3 日	99.99	100,000	9,998,685.60
150417	15 农发 17	2017 年 1 月 3 日	100.56	200,000	20,111,187.25
111698499	16 武汉农 商行 CD001	2017 年 1 月 4 日	99.84	400,000	39,936,786.48
111698644	16 辽阳银 行 CD056	2017 年 1 月 20 日	99.04	400,000	39,616,309.66
111698653	16 萧山农	2017 年 1 月 20 日	99.04	400,000	39,616,309.66

	商银行 CD043				
111698825	16 阜新银 行 CD095	2017 年 1 月 20 日	98.98	400,000	39,590,312.58
合计				2,100,000	208,866,601.81

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险合理稳定收益品种，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。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会为核心的、由督察长、监察及风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和部分定期存款存放在本基金的托管行中国民生银行；其他定期存款存放在具有基金托管资格的广发银行股份有限公司等，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	9,998,771.76
A-1 以下	-	-
未评级	1,210,218,058.49	9,993,054.10
合计	1,210,218,058.49	19,991,825.86

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	170,324,908.86	-
合计	170,324,908.86	-

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2016 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 194,940,587.58 元将在 1 个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产						
银行存款	744,067,739.93	-	-	-	-	744,067,739.93
交易性金融资 产	1,211,847,012.67	168,695,954.68	-	-	-	-1,380,542,967.35
买入返售金融 资产	2,433,603,957.03	-	-	-	-	-2,433,603,957.03
应收利息	-	-	-	-	-7,628,263.28	7,628,263.28
应收申购款	-	-	-	-	0.11	0.11
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,389,518,709.63	168,695,954.68	-	-	-7,628,263.39	4,565,842,927.70
负债						
卖出回购金融 资产款	194,940,587.58	-	-	-	-	194,940,587.58
应付管理人报 酬	-	-	-	-	792,826.86	792,826.86
应付托管费	-	-	-	-	120,125.28	120,125.28
应付销售服务 费	-	-	-	-	34,875.64	34,875.64
应付交易费用	-	-	-	-	59,207.12	59,207.12
应付利息	-	-	-	-	531,484.48	531,484.48
应付利润	-	-	-	-	417,959.89	417,959.89
其他负债	-	-	-	-	89,000.00	89,000.00
负债总计	194,940,587.58	-	-	-	-2,045,479.27	196,986,066.85
利率敏感度缺 口	4,194,578,122.05	168,695,954.68	-	-	-5,582,784.12	4,368,856,860.85
上年度末 2015年12月31 日						
资产						
银行存款	1,191,195,202.46	-	-	-	-	-1,191,195,202.46
结算备付金	235,048,500.05	-	-	-	-	235,048,500.05
交易性金融资 产	9,998,771.76	9,993,054.10	-	-	-	19,991,825.86
买入返售金融 资产	800,002,680.00	-	-	-	-	800,002,680.00
应收利息	-	-	-	-	929,470.56	929,470.56

其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,236,245,154.27	9,993,054.10	-	-	929,470.56	2,247,167,678.93
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	124,667.89	124,667.89
应付托管费	-	-	-	-	18,889.06	18,889.06
应付销售服务费	-	-	-	-	94,445.37	94,445.37
应付交易费用	-	-	-	-	10,365.07	10,365.07
应付利润	-	-	-	-	142,762.27	142,762.27
其他负债	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	-	441,129.66	441,129.66
利率敏感度缺口	2,236,245,154.27	9,993,054.10	-	-	488,340.90	2,246,726,549.27

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，在影子价格监控机制有效的前提下，若市场利率上升或下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会发生重大变动。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,380,542,967.35 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 19,991,825.86 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本年度变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,380,542,967.35	30.24
	其中: 债券	1,380,542,967.35	30.24
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,433,603,957.03	53.30
	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	744,067,739.93	16.30
4	其他各项资产	7,628,263.39	0.17
5	合计	4,565,842,927.70	100.00

8.2 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	2.27	
	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	194,940,587.58	4.46
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	37
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超过 120 天的情形。

8.3.2 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	75.02	4.46
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	5.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	6.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	7.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	9.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
	合计	104.33	4.46

8.4 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。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	170,324,908.86	3.90
	其中：政策性金融债	170,324,908.86	3.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	159,953,268.26	3.66
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,050,264,790.23	24.04
8	其他	-	-
9	合计	1,380,542,967.35	31.60
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。

8.6 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	111619200	16 恒丰银行 CD200	1,000,000	98,552,942.50	2.26
2	111609253	16 浦发 CD253	500,000	49,986,401.42	1.14
3	011697046	16 沪华信 SCP007	500,000	49,912,345.59	1.14
4	111616189	16 上海银	500,000	49,580,952.75	1.13

		行 CD189			
5	111697820	16 贵阳银 行 CD044	500,000	49,473,325.73	1.13
6	111698499	16 武汉农 商行 CD001	400,000	39,936,786.48	0.91
7	111698644	16 辽阳银 行 CD056	400,000	39,616,309.66	0.91
7	111698653	16 萧山农 商银行 CD043	400,000	39,616,309.66	0.91
8	111698825	16 阜新银 行 CD095	400,000	39,590,312.58	0.91
9	111699057	16 齐鲁银 行 CD043	400,000	39,561,083.76	0.91
10	150417	15 农发 17	300,000	30,166,780.88	0.69

8.7 “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	-0.2210%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0630%

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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	7,628,263.28
4	应收申购款	0.11
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	7,628,263.39

8.9.4 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
新沃 通宝 A	1,925	51,259.77	57,798,937.96	58.58%	40,876,126.32	41.42%
新沃 通宝 B	40	106,754,544.91	4,224,206,568.34	98.92%	45,975,228.23	1.08%
合计	1,965	2,223,336.82	4,282,005,506.30	98.01%	86,851,354.55	1.99%

9.2 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	新沃通宝 A	1,879,044.56	1.90%
	新沃通宝 B	0.00	-
	合计	1,879,044.56	0.04%

9.3 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	新沃通宝 A	>100
	新沃通宝 B	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开	新沃通宝 A	0~10

放式基金	新沃通宝 B	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	新沃通宝 A	新沃通宝 B
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	2,598,447,621.53	8,440,135,740.97
减:本报告期基金总赎回份额	4,746,499,106.52	4,169,953,944.40
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	98,675,064.28	4,270,181,796.57

注：表内“总申购份额”含红利再投、级别调整入份额；“总赎回份额”含级别调整出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 80,000 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：租用方正证券上海席位（席位号 34786）和深圳席位（席位号 000293）。

11.7.2 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	-	-	40,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 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	新沃基金管理有限公司关于增加银河证券股份有限公司为代	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 1 月 8 日

	销机构的公告		
2	新沃通宝货币市场基金 2015 年 第 4 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 1 月 22 日
3	新沃通宝货币市场基金暂停大 额申购（含定投）业务公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 2 月 3 日
4	新沃基金管理有限公司关于增 加交通银行股份有限公司为代 销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 2 月 5 日
5	新沃基金管理有限公司关于增 加上海陆金所资产管理有限公 司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 3 月 2 日
6	新沃基金管理有限公司关于增 加北京微动利投资管理有限公 司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 3 月 21 日
7	新沃基金管理有限公司关于增 加泰诚财富基金销售（大连）有 限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 3 月 23 日
8	新沃通宝货币市场基金 2015 年 年度报告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 3 月 26 日
9	新沃通宝货币市场基金 2015 年 年度报告摘要	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 3 月 26 日
10	新沃基金管理有限公司关于开 通网上交易机构版业务的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 4 月 1 日
11	新沃基金管理有限公司关于旗 下基金参加新兰德开展的基金 申（认）购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 4 月 1 日
12	新沃通宝货币市场基金 2016 年 第 1 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 4 月 21 日
13	新沃基金关于开通直销网上交	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 5 月 11

	易货币基金 T+0 快速赎回业务的公告		日
14	新沃基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年5月16日
15	新沃基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年5月17日
16	新沃基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年5月17日
17	新沃基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年5月17日
18	新沃基金管理有限公司关于增加乾道金融信息服务（北京）有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年5月18日
19	新沃基金关于开通机构直销网上交易货币基金 T+0 快速赎回业务的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年5月19日
20	新沃通宝货币市场基金招募说明书（更新）（2016年第1号）	指定报刊和/或管理人网站	2016年5月31日
21	新沃通宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2016年第1号）	指定报刊和/或管理人网站	2016年5月31日
22	新沃基金管理有限公司关于增加北京懒猫金融信息服务有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年6月17日
23	新沃基金管理有限公司关于增	指定报刊和/或管理人网站	2016年6月17

	加大泰金石投资管理有限公司 为代销机构的公告		日
24	新沃基金管理有限公司关于增 加上海联泰资产管理有限公司 为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年6月17 日
25	关于新沃通宝货币市场基金基 金经理变更的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年6月21 日
26	新沃基金管理有限公司关于增 加北京植信基金销售有限公司 为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年7月15 日
27	新沃通宝货币市场基金 2016 年 第 2 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2016年7月19 日
28	新沃基金管理有限公司关于增 加上海攀赢金融信息服务有限 公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年7月22 日
29	新沃基金管理有限公司关于增 加上海天天基金销售有限公司 为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年7月27 日
30	新沃基金管理有限公司关于增 加北京恒天明泽基金销售有限 公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年8月3 日
31	新沃基金管理有限公司关于增 加诺亚正行（上海）基金销售投 资顾问有限公司为代销机构的 公告	指定报刊和/或管理人网站	2016年8月5 日
32	关于新沃通宝货币市场基金增 设 B 类基金份额并修改基金合 同、招募说明书和托管协议的公 告	指定报刊和/或管理人网站	2016年8月5 日

33	新沃通宝货币市场基金 2016 年半年度报告摘要	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 8 月 25 日
34	新沃通宝货币市场基金 2016 年半年度报告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 8 月 25 日
35	新沃基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 9 月 7 日
36	新沃基金管理有限公司关于增加申万宏源西部证券有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 9 月 26 日
37	新沃基金管理有限公司关于增加申万宏源证券有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 9 月 26 日
38	新沃基金管理有限公司关于增加天津国美基金销售有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 9 月 27 日
39	新沃通宝货币市场基金 2016 年第三季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 10 月 26 日
40	新沃基金管理有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 10 月 27 日
41	关于新沃通宝货币市场基金修改基金合同的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 11 月 5 日
42	新沃通宝货币市场基金托管协议	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 11 月 5 日
43	新沃通宝货币市场基金基金合同	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 11 月 5 日
44	新沃基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为代销机	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 11 月 15 日

	构的公告		
45	新沃基金管理有限公司关于增加中信证券（山东）有限责任公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 11 月 15 日
46	新沃基金管理有限公司关于增加中信证券股份有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 11 月 15 日
47	新沃基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在天津国美基金销售有限公司定期定额申购起点金额的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 11 月 28 日
48	关于新沃通宝货币市场基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 12 月 3 日
49	新沃通宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2016 年第 2 号）	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 12 月 3 日
50	新沃通宝货币市场基金招募说明书（更新）（2016 年第 2 号）	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 12 月 3 日
51	新沃基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 12 月 14 日
52	新沃基金管理有限公司关于增加上海华信证券有限责任公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 12 月 21 日
53	新沃基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为代销机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2016 年 12 月 22 日

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的办公场所。

12.3 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

2017年3月31日