

# 新沃通利纯债债券型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告

2017-06-30

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2017-07-21

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金产品概况](#)

[基金基本情况](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[本报告期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](#)

[自基金合同生效以来基金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](#)

[其他指标](#)

[管理人报告](#)

[基金经理（或基金经理小组）简介](#)

[管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明](#)

[公平交易专项说明](#)

[公平交易制度的执行情况](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[报告期内基金的投资策略和业绩表现说明](#)

[报告期内基金的投资策略和运作分析](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#)

[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](#)

[投资组合报告](#)

[报告期末基金资产组合情况](#)

[报告期末按行业分类的股票投资组合](#)

[报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合](#)

[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股票投资明细](#)

[报告期末按债券品种分类的债券投资组合](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细](#)

[报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细](#)

[报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明](#)

[报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细](#)

[本基金投资股指期货的投资政策](#)

[报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明](#)

[本期国债期货投资政策](#)

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本期国债期货投资评价  
投资组合报告附注  
受到调查以及处罚情况  
申明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  
其他资产构成  
报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
投资组合报告附注的其他文字描述部分  
开放式基金份额变动  
基金管理人运用固有资金投资本基金情况  
基金管理人持有本基金份额变动情况  
基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细  
报告期末发起式基金发起资金持有份额情况  
影响投资者决策的其他重要信息  
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  
影响投资者决策的其他重要信息  
备查文件目录  
备查文件目录  
存放地点  
查阅方式

#### 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 7 月 19 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 2017 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金简称

新沃通利纯债

场内简称

基金主代码

**003664**

基金运作方式

契约型开放式  
基金合同生效日

2016-12-27

报告期末基金份额总额

97,820,964.05

投资目标

本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过主要配置公司债券、企业债券等固定收益类金融工具，追求资产的长期稳定增值，力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。

投资策略

本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用期限匹配下的主动性投资策略，主要包括：类属资产配置策略、期限结构策略、久期调整策略、个券选择策略、分散投资策略及资产支持证券等品种投资策略等投资管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种固定收益品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

业绩比较基准

中债综合指数收益率

风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等预期风险/收益的产品。

基金管理人

新沃基金管理有限公司

基金托管人

交通银行股份有限公司

下属 2 级基金的基金简称

新沃通利纯债 A

新沃通利纯债 C

下属 2 级基金的场内简称

下属 2 级基金的交易代码

003664

003665

报告期末下属 2 级基金的份额总额

96,452,653.24

1,368,310.81

下属 2 级基金的风险收益特征

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标

主基金(元)

A(元)

2017-04-01 - 2017-06-30

B(元)

2017-04-01 - 2017-06-30

本期已实现收益

-2,540,113.14

-9,047.28

本期利润

-998,792.60

482.26

加权平均基金份额本期利润

-0.0043

0.0003

期末基金资产净值

97,702,047.86

1,420,494.58

期末基金份额净值

1.0130

1.0381

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

基金净值表现

本报告期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  
阶段

净值增长率①

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

注：1、本基金合同于 2016 年 12 月 27 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。

本报告期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 A  
阶段

净值增长率①

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

过去三个月

0.68 %

0.08 %

0.22 %

0.08 %

0.46 %

0.00 %

本报告期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 B  
阶段

净值增长率①

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

过去三个月

0.54 %

0.08 %

0.22 %

0.08 %

0.32 %

0.00 %

自基金合同生效以来基金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  
注：1、本基金合同于 2016 年 12 月 27 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。

自基金合同生效以来基金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  
A

自基金合同生效以来基金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  
B

其他指标

单位：人民币元

其他指标

报告期（2017-04-01 至 2017-06-30）

其他指标

报告期（2017-06-30）

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

武亮

本基金的基金经理、固定收益部总经理

2016-12-29

-

5 年

香港城市大学博士，中国籍。2011 年 8 月至 2012 年 9 月任职于海通证券,担任研究所固定收益研究员；2012 年 10 月至 2016 年 10 月任职于平安资产管理有限责任公司，历任债券研究部策略主管、固收资管部投资经理等职务；2016 年 10 月加入新沃基金，任固定收益部总经理。

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。

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。

公平交易专项说明

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。

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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2017 年 2 季度宏观经济整体保持平稳，社会融资总量继续保持稳步增长，企业经营活力分化加大，房地产投资整体保持平稳，消费增速出现小幅下降。货币政策整体保持平稳，但监管政策趋严，债券市场新增融资大幅下降。

二季度债券市场整体呈现下跌态势，10 年期国债收益率上行 29bp，5 年 AA+中期票据收益率上行 26bp，中证综合债指数二季度上涨 0.26%。报告期内，本基金采取相对稳健的投资策略，继续以中高等级信用债作为主要配置策略，同时进行了部分利率债券的波段操作，并持有了部分国债期货头寸用以套期保值，力求在控制组合风险的同时为持有人获取稳定回报。

报告期内基金的业绩表现

报告期内，新沃通利纯债 A 净值增长率为 0.68%，新沃通利纯债 C 净值增长率为 0.54%，同期业绩基准收益率 0.22%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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的情形。

投资组合报告

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

权益类投资

-	
-	
其中：股票	
-	
-	
2	
固定收益投资	
80,570,200.00	
76.76	
其中：债券	
80,570,200.00	
76.76	
资产支持证券	
-	
-	
3	
贵金属投资	
-	
-	
4	
金融衍生品投资	
-	
-	
5	
买入返售金融资产	
19,200,148.80	
18.29	
其中：买断式回购的买入返售金融资产	
-	
-	
6	
银行存款和结算备付金合计	
3,954,867.51	
3.77	
7	
其他资产	
1,236,505.01	
1.18	
8	
合计	
104,961,721.32	
100.00	
报告期末按行业分类的股票投资组合	
报告期末按行业分类的境内股票投资组合	

序号

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

**A**

农、林、牧、渔业

-

-

**B**

采矿业

-

-

**C**

制造业

-

-

**D**

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

**E**

建筑业

-

-

**F**

批发和零售业

-

-

**G**

交通运输、仓储和邮政业

-

-

**H**

住宿和餐饮业

-

-

**I**

信息传输、软件和信息技术服务业

-

-

**J**

金融业

-

-



K

房地产业

-

-

L

租赁和商务服务业

-

-

M

科学研究和技术服务业

-

-

N

水利、环境和公共设施管理业

-

-

O

居民服务、修理和其他服务业

-

-

P

教育

-

-

Q

卫生和社会工作

-

-

R

文化、体育和娱乐业

-

-

S

综合

-

-

合计

-

-

注： 本基金本报告期末未持有股票。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A 基础材料

-

-

B 消费者非必需品

-

-

C 消费者常用品

-

-

D 能源

-

-

E 金融

-

-

F 医疗保健

-

-

G 工业

-

-

H 信息技术

-

-

I 电信服务

-

-

J 公用事业

-

-

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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股票投资明细  
序号

股票代码

股票名称

数量（股）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有股票。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号

债券品种

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1		
国家债券		
	7,091,800.00	
	7.15	
2		
央行票据		
	-	
	-	
3		
金融债券		
	-	
	-	
其中：政策性金融债		
	-	
	-	
4		
企业债券		
	33,848,400.00	
	34.15	
5		
企业短期融资券		
	-	
	-	
6		
中期票据		
	-	
	-	
7		
可转债（可交换债）		
	-	
	-	
8		
同业存单		
	39,630,000.00	
	39.98	
9		
其他		
	-	
	-	
10		
合计		
	80,570,200.00	
	81.28	
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债券投资明细		

序号  
债券代码  
债券名称  
数量（张）  
公允价值（元）  
占基金资产净值比例（%）

1

111799934  
17 宁波银行 CD111  
100,000  
9,964,000.00  
10.05

2

1680212  
16 温城专项债 02  
100,000  
9,960,000.00  
10.05

3

111710281  
17 兴业银行 CD281  
100,000  
9,889,000.00  
9.98

3

111715170  
17 民生银行 CD170  
100,000  
9,889,000.00  
9.98

4

111711210  
17 平安银行 CD210  
100,000  
9,888,000.00  
9.98

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  
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

序号  
贵金属代码  
贵金属名称  
数量（份）  
公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险说明

公允价值变动总额合计(元)

-

股指期货投资本期收益(元)

-

股指期货投资本期公允价值变动(元)

-

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

报告期内本产品进行了以套期保值为目的的国债期货交易操作，根据组合需求灵活调整了国债期货的多空仓位配置。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

0T1712

10 年期国债期货 1712 合约

8

7,614,400.00

-22,550.00

-

0T1709

10 年期国债期货 1709 合约

-12

-11,428,800.00

34,250.00

-

公允价值变动总额合计(元)

11,700.00

国债期货投资本期收益（元）

546,550.00

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-33,000.00

注：注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示，单位为手。

本期国债期货投资评价

报告期内本产品的国债期货操作有效的降低了组合的波动风险。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

申明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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

其他资产构成

单位：人民币元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

251,283.51

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

-

4

应收利息

982,721.50

5

应收申购款

2,500.00

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

1,236,505.01

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

开放式基金份额变动

单位：份

项目

新沃通利纯债

新沃通利纯债 A

新沃通利纯债 C

报告期期初基金份额总额

375,814,835.09

1,995,799.24

报告期期间基金总申购份额

54,896,124.97

1,423,982.40

减：报告期期间基金总赎回份额

334,258,306.82

2,051,470.83

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）

报告期期末基金份额总额

97,820,964.05

96,452,653.24

1,368,310.81

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目

新沃通利纯债

新沃通利纯债 A

新沃通利纯债 C

报告期期初管理人持有的本基金份额

报告期期间买入/申购总份额

报告期期间卖出/赎回总份额

报告期期末管理人持有的本基金份额

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)

-

-

-

注：本报告期内，本基金管理人未持有本基金份额。

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  
合计

注：本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-%

-%

基金管理人高级管理人员

-%

-%

基金经理等人员

-%

-%

基金管理人股东

-%

-%

其他

-%

-%

合计

-%

-%

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

2017/4/27-2017/6/30

0.00

49,904,182.05

0.00

49,904,182.05

51.020000 %

2

2017/4/1-2017/5/03

30,006,200.00

0.00

0.00

30,006,200.00

30.670000 %

3

2017/4/1-2017/5/25

300,022,000.00

0.00

300,022,000.00

0.00

0.000000 %

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

本基金为债券型基金，属于中等预期风险的产品。公司对该基金拥有完全自主投资决策权。报告期末本基金持仓品种以高等级信用债为主。在市场条件不利的情况下，单一投资者赎回本基金可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，叠加基金单位净值最末位小数四舍五入的原因，单一投资者赎回本基金可能给存续投资者带来净值损失。

影响投资者决策的其他重要信息

当持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。

备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新沃通利纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；

- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会规定的其他备查文件。

存放地点

基金管理人和/或基金托管人的办公场所。

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。