

# 新沃通利纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2017 年第 1 号

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

## 重要提示

本基金经中国证监会 2016 年 7 月 13 日证监许可[2016]1599 号文注册募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为债券型证券投资基金。投资的范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等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（可分离交易可转债的纯债部分除外）、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，基金管理人届时根据相关规定在履行适当程序后，可将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金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%。

投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响的市场风险，因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的利率风险或负收益风险，因债券和票据发行主体信用状况恶化而可能产生的到期不能兑付的信用风险，因本产品相关技术、规则、操作等创新性造成基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险。本基金的特定风险详见招募说明书风险揭示章节。投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策，自行承担投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的买者自负原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

除上述根据修改基金合同进行的更新外，本更新的招募说明书所载内容截止日为 2017 年 6 月 27 日，有关财务数据和净值截止日为 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：新沃基金管理有限公司

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

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

法定代表人：朱灿

成立时间：2015年08月19日

中国证监会批准设立文号：中国证监会证监许可[2015]1867号

注册资本：1亿元人民币

联系人：周恒

电话：010-58290600

传真：010-58290555

股东名称及出资比例：

新沃资本控股集团有限公司 70%

新沃联合资产管理有限公司 30%

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

朱灿先生，董事长，博士研究生。历任山东证券济南营业总部部门经理、中创山东证券总部副总经理，国泰证券山东分公司管理人员，国泰基金公司市场部经理，新华基金管理有限公司副总裁，中国民生银行董事会投资管理中心副总经理（主持工作），现任新沃股权投资基金管理（天津）有限公司监事、新沃置业有限公司执行董事、新沃联合资产管理有限公司董事、大连君泰投资管理有限公司董事、广州新沃司浦林投资管理有限公司董事、北京中科新沃投资管理有限公司执行董事、上海金融服务有限公司法人、新沃资本控股集团有限公司董事长，新沃基金管理有限公司董事长。

库三七先生，董事，经济学硕士。历任中国工商银行北京市分行资金运营部首席外汇交易员、支行副行长、总行办公室秘书、信贷管理部处长，中国工商银行（亚洲）有限公司总经理助理，中国工商银行香港分行总经理，工银瑞信基金管理有限公司副总经理，现任新沃基金管理有限公司总经理。

杨依政，董事，法学学士。历任山东证券交易中心部门经理，源深（上海）咨询有限公司执行董事，现任新沃资本控股集团有限公司部门负责人、副总裁，新沃置业有限公司常务副总裁、总裁。

黄震先生，独立董事，法学博士。历任人民日报编辑，中央财经大学法学院副教授，中央财经大学国防经济与管理研究院副教授、副院长，现任中央财经大学法学院教授。

项兵先生，独立董事，博士。历任加拿大 Calgary 大学副教授，香港科技大学讲师，中欧国际工商学院核心教授，香港中文大学访问学者，北京大学光华管理学院教授、博导，现任长江商学院院长、教授。

刘燕女士，独立董事，工商管理硕士。历任辽宁省国际信托投资公司律师，北京炜衡律师事务所专职律师，北京天同律师事务所创始合伙人，现任北京大成律师事务所高级合伙人。

姜培兴，独立董事，公共管理硕士及工商管理硕士。历任中国人保信托投资公司证券部证券交易员及期货业务部助理总经理和副总经理，深圳阳光基金管理有限公司总经理，中国银河证券有限责任公司筹备组成员后出任总裁助理，招银国际金融有限公司总裁，招商银行总行投资管理部总经理，建银国际（控股）有限公司副行政总裁，现任中德证券有限责任公司总经理。

### 2、监事

陈垂锋先生，监事，学士。历任中国出国人员服务总公司助理，北京永拓会计师事务所经理，北京中平建会计师事务所经理，新华通投资发展有限公司总会计师，现任新沃资本控股集团有限公司风险总监。

刘小舫女士，监事，金融学硕士。历任浙江天健会计师事务所审计部高级审计师；国泰基金管理有限公司稽核监察部信息披露专员；华夏基金管理有限公司法律监察部监察经理。现任新沃基金管理有限公司监察稽核部总经理。

### 3、高级管理人员

库三七先生，总经理。（简历参见上述董事会成员介绍）

陈阳先生，督察长，法学学士。历任北京华旗资讯科技有限公司知识产权及法务专员，中国民族证券有限责任公司合规部副总经理，中国上市公司协会公司发展部专员，现任新沃基金管理有限公司督察长。

王靖飞先生，副总经理，硕士。历任农行广西分行银行卡业务负责人，农行总行电子银行部电子商务负责人，银华基金管理有限公司电子商务部总经理，现任新沃基金管理有限公司副总经理。

丁平先生，副总经理，硕士。历任上海农商银行金融市场部交易员，上海海通证券资产管理有限公司固定收益部投资经理，平安资产管理有限责任公司固收资管部投资经理。现任新沃基金管理有限公司副总经理。

#### 4、基金经理

武亮先生，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。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：库三七

成员：丁平、武亮、邵将、许海韬

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 二、基金托管人

#### (一) 基本情况

##### 1.基本情况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：陆志俊

电话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月，交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2016年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第13位，较上年上升4位；根据2016年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第153位，较上年上升37位。

截至2017年3月31日，交通银行资产总额为人民币87337.11亿元。2017年一季度，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币193.23亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称托管中心）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

#### (二) 主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事，2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长，2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生 2013 年 11 月起任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月起任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2017 年 3 月 31 日，交通银行共托管证券投资基金 288 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

## 三、相关服务机构

### 一、基金发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）新沃基金管理有限公司直销中心

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

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

成立时间：2015 年 08 月 19 日

法定代表人：朱灿

注册资本：1 亿元人民币

电话：010-58290666、010-58290627

传真：010-58290555

联系人：张蓁蓁

##### （2）新沃基金管理有限公司网上直销系统（www.sinvofund.com）

#### 2、其他销售机构

##### （1）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

客服电话：400-166-1188

公司网站：8.jrj.com.cn

##### （2）一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：刘栋栋

客服电话：400-001-1566

公司网站: [www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(3) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

办公地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 16 层

法定代表人: 董浩

联系人: 牛亚楠

客服电话: 400-068-1176

公司网站: [www.jimufund.com](http://www.jimufund.com)

(4) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人: 薛峰

联系人: 童彩平

客服电话: 4006-788-887

公司网站: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(5) 深圳珠海盈米财富管理有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203 室

法定代表人: 肖雯

联系人: 黄敏嫦

客服电话: 020-89629066

公司网站: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(6) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路甲 40 号二十一世纪大厦 A303

法定代表人: 王岩

联系人: 胡明会

客服电话: 400-819-9868

公司网站: [www.tdyhfund.com](http://www.tdyhfund.com)

(7) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 郭坚

联系人: 宁博宇

客服电话: 400-821-9031

公司网站: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(8) 北京微动利投资管理有限公司

注册地址: 北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 室

办公地址: 北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 室

法定代表人: 梁洪军

联系人: 季长军

客服电话: 400-819-6665

公司网站: [www.buyforyou.com.cn](http://www.buyforyou.com.cn)

(9) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人: 林卓

联系人: 张晓辉

客服电话: 4006-411-999

公司网站: [www.taichengcaifu.com](http://www.taichengcaifu.com)

(10) 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人: 陈有安

联系人: 邓颜

客服电话: 4008-888-888

公司网站: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(11) 和讯信息科技有限公司

注册地址: 北京朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址: 上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18楼

法定代表人: 王莉

联系人: 刘洋

客服电话: 400-920-0022

公司网站: [www.hexun.com](http://www.hexun.com)

(12) 交通银行股份有限公司

注册地址: 上海市银城中路188号

办公地址: 上海市银城中路188号

法定代表人: 牛锡明

联系人: 张宏革

客服电话: 95559

公司网站: [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(13) 北京汇成基金销售有限公司

办公地址: 北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

法定代表人: 王伟刚

客服电话: 400-619-9059

公司网站: [www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(14) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址: 浙江省杭州市翠柏路7号电子产业园2号楼2层同花顺

法定代表人: 凌顺平

客服电话: 4008-773-772

公司网站: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(15) 北京钱景财富投资管理有限公司

办公地址: 北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人: 赵荣春

客服电话: 400-893-6885

公司网站: [www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(16) 乾道金融信息服务(北京)有限公司

办公地址: 北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人: 王兴吉

客服电话: 400-088-8080

公司网站: [www.qiandaojr.com](http://www.qiandaojr.com)

(17) 上海联泰资产管理有限公司

办公地址: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人: 燕斌

客服电话: 4000-466-788

公司网站: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(18) 北京植信基金销售有限公司

办公地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源国食苑 10 号楼

法定代表人: 杨纪峰

客服电话: 4006-802-123

公司网站: [www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(19) 上海天天基金销售有限公司

办公地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人: 其实

客服电话: 400-1818-188

公司网站: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(20) 北京恒天明泽基金销售有限公司

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人: 李悦

客服电话: 400-898-0618

公司网站: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(21) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

办公地址: 上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋

法定代表人: 汪静波

客服电话: 400-821-5399

公司网站: [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(22) 天津国美基金销售有限公司

办公地址: 北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人: 丁东华

客服电话: 400-111-0889

公司网站: [www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

(23) 深圳盈信基金销售有限公司

办公地址: 大连市中山区南山路 155 号南山 1910 小区 A3-1

法定代表人: 苗宏升

客服电话: 4007-903-688

公司网站: [www.fundying.com](http://www.fundying.com)

(24) 深圳市金斧子投资咨询有限公司

办公地址: 深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人: 赖任军

客服电话: 4009-500-888

公司网站: [www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

(25) 上海利得基金销售有限公司

办公地址: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人: 沈继伟

客服电话: 400-033-7933

公司网站: [www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

(26) 申万宏源证券有限公司

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

客服电话: 95523 或 4008-895-523

公司网站: <http://www.swhysc.com/>

(27) 申万宏源西部证券有限公司

办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人: 韩志谦

客服电话: 400-800-0562

公司网站: [www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(28) 大泰金石投资管理有限公司

办公地址: 上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人: 袁顾明

客服电话: 400-928-2266

公司网站: [www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

(29) 北京懒猫金融信息服务有限公司

办公地址: 北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号

法定代表人: 许现良

客服电话: 400-150-0882

公司网站: [www.lanmao.com](http://www.lanmao.com)

(30) 上海攀赢金融信息服务有限公司

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路 488 号太平金融大厦 603 室

法定代表人: 田为奇

客服电话: 021-68889082

公司网站: [www.pytz.cn](http://www.pytz.cn)

(31) 上海万得投资顾问有限公司

办公地址: 上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人: 王延富

客服电话: 400-821-0203

公司网址: [www.520fund.com](http://www.520fund.com)

(32) 上海华信证券有限责任公司

办公地址: 上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人: 郭林

客服电话: 400-820-5999

公司网站: [www.shhxzq.com](http://www.shhxzq.com)

(33) 北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩) N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

客服电话：010-62675369

公司网站：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

(34) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层

法定代表人：陈超

客服电话：个人业务：95118 企业业务：400-088-8816

公司网站：<http://fund.jd.com>

(35) 北京格上富信投资顾问有限公司

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

客服电话：400-066-8586

公司网站：[www.igesafe.com](http://www.igesafe.com)

(36) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501--1504 室

法定代表人：陈洪生

客服电话：400-918-0808

公司网站：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

(37) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-089-1289

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(38) 凤凰金信（银川）投资管理有限公司

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院朝来高科技产业园 18 号楼(100000)

法定代表人：程刚

客服电话：400-810-5919

公司网站：[www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

(39) 南京苏宁基金销售有限公司

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

客服电话：95177

公司网站：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

(40) 北京晟视天下投资管理有限公司

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街万通中心 D 座 21 层

法定代表人：蒋煜

客服电话：400-818-8866

公司网站：[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

(41) 江苏汇林保大基金销售有限公司

办公地址：南京市高淳区砖墙集镇 78 号

法定代表人：吴言林

客服电话：025-56663409

公司网站：[www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

(42) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

办公地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第 7 幢 23 层 1 号、4 号

法定代表人：吴言林

客服电话：400-027-9899

公司网站：www.buyfunds.cn

(43) 中信期货有限公司

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

公司网站：www.citicsf.com

(44) 中信证券（山东）有限责任公司

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

公司网站：www.citicssd.com

(45) 中信证券股份有限公司

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

客服电话：010-60838888

公司网站：www.cs.ecitic.com

## 二、登记机构

名称：新沃基金管理有限公司

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

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

成立时间：2015 年 08 月 19 日

法定代表人：朱灿

注册资本：1 亿元人民币

电话：010-58290600

传真：010-58290500

联系人：王巍

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陆奇

联系人：陆奇

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

首席合伙人：赵柏基

住所：中国北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座26楼  
办公地址：中国北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座26楼  
邮政编码：100020  
电话：65338888  
传真：65338800  
签章会计师：单峰、张勇  
业务联系人：张勇

#### 四、基金的名称

新沃通利纯债债券型证券投资基金

#### 五、基金的类型

债券型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

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。

#### 七、基金的投资方向

本基金投资的范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等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（可分离交易可转债的纯债部分除外）、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，基金管理人届时根据相关规定在履行适当程序后，可将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金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%。

#### 八、基金的投资策略

##### （一）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。

##### 1、类属资产配置策略

本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率趋势，判断证券市场对上述变量和政策的反应，并根据不同类属资产的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好以及流动性等因素，采取积极投资策略，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

##### 2、期限结构策略

收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。定性方法为：在对经济周期和货币政策分析下，对收益率曲线形状可能变化给予一个方向判断；定量方法为：参考收益率曲线的历史趋势，同时结合未来的各期限的供给分布以及投资者的期限偏好，对未来收益率曲线形状做

出判断。

在对于收益率曲线形状变化和变动幅度做出判断的基础上，结合情景分析结果，提出可能的期限结构配置策略。

### 3、久期调整策略

本基金将根据中长期内的宏观经济波动趋势，形成对未来市场利率变动方向的预期，在一定范围内适当对资产组合久期进行动态调整。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以增强投资组合收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌带来的风险。

### 4、个券选择策略

本基金将利用公司内部信用评级体系，对债券发行主体所在行业发展以及公司治理、财务状况等信息进行深入研究并及时跟踪。在此基础上，结合债券发行具体条款，对债券的收益性、安全性、流动性等因素进行分析。同时参考债券外部评级，对债券发行人和债券的信用风险细致甄别，做出综合评价，并着重挑选资质良好及信用评级被低估的券种进行投资。

### 5、分散投资策略

本基金将适当分散行业选择和个券配置的集中度，以降低个券及行业信用事件给投资组合带来的冲击。

### 6、国债期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与国债期货投资。通过对国债期货市场运行趋势的研究，结合基金组合的实际情况及对国债期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，选择合适的合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。

### 7、资产支持证券等品种投资策略

包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

## 九、基金的业绩比较基准

中债综合指数收益率。

中债综合指数由中央国债登记结算有限公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果指数编制机构变更或停止中债综合指数的编制及发布，或者中债综合指数由其他指数替代，或者由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中债综合指数不宜继续作为基准指数，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可变更业绩比较基准并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

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。

## 十一、基金的投资组合报告

以下内容摘自本基金 2017 年第 1 季度报告：

### 1.1 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 权益投资 --

其中：股票 --

2 基金投资 --

3 固定收益投资 401,566,374.00 86.43

其中：债券 401,566,374.00 86.43

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 55,311,942.54 11.91
- 8 其他资产 7,726,689.57 1.66
- 9 合计 464,605,006.11 100.00

#### 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 1.3 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 20,697,574.00 5.44

2 央行票据 --

3 金融债券 --

其中：政策性金融债 --

4 企业债券 222,774,800.00 58.59

5 企业短期融资券 50,117,000.00 13.18

6 中期票据 39,060,000.00 10.27

7 可转债（可交换债） --

8 同业存单 68,917,000.00 18.13

9 其他 --

10 合计 401,566,374.00 105.62

#### 1.4 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 1680212 16 温城专项债 02 300,000 30,189,000.00 7.94

2 041660038 16 深燃气 CP002 300,000 30,099,000.00 7.92

3 111790193 17 广东顺德农商行 CD012 300,000 29,358,000.00 7.72

4 136801 16 津创 01 300,000 27,927,000.00 7.35

5 1580134 15 津环城债 250,000 25,867,500.00 6.80

#### 1.5 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。

#### 1.6 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。

#### 1.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 1.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 1.8.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的。国债期货多头、空头的合约价值与当前的组合债券现货的头寸及

未来拟投资的现券规模相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以合理控制组合久期。

#### 1.8.2 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

OT1706 10年期国债期货 1706 合约 41 39,708,500.00 -76,200.00 -

OT1712 10年期国债期货 1712 合约 7 6,650,000.00 26,300.00 -

OT1709 10年期国债期货 1709 合约 -38 -36,421,100.00 90,450.00 -

TF1706 5年期国债期货 1706 合约 -10 -9,920,500.00 -8,000.00 -

TF1709 5年期国债期货 1709 合约 -26 -25,619,100.00 12,150.00 -

公允价值变动总额合计(元) 44,700.00

国债期货投资本期收益(元) 97,600.00

国债期货投资本期公允价值变动(元) 44,700.00

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。

#### 1.8.3 本期国债期货投资评价

报告期内，基金管理人根据对宏观经济的判断与未来组合配置的安排，灵活运用国债期货工具对组合进行久期管理，在保证基金资产安全的基础上，力求稳定组合净值表现，为投资者创造长期稳定的投资增值。

#### 1.9 投资组合报告附注

1.9.1 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。

1.9.2 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。

#### 1.9.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 1,168,302.39

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 6,533,187.18

5 应收申购款 25,200.00

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 7,726,689.57

#### 1.9.4 报告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。

#### 1.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 1.9.6 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。

## 十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产

但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩截止日为2017年3月31日。

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

#### 新沃通利纯债 A

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 — —

2017 年 1 月 1 日至 2017 年 3 月 31 日 0.60% 0.04% -0.34% 0.07% 0.94% -0.03%

2016 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 3 月 31 日 0.62% 0.04% 0.12% 0.08% 0.50% -0.04%

#### 新沃通利纯债 C

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 — —

2017 年 1 月 1 日至 2017 年 3 月 31 日 3.23% 0.35% -0.34% 0.07% 3.57% 0.28%

2016 年 12 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 3 月 31 日 3.25% 0.34% 0.12% 0.08% 3.13% 0.26%

### 十三、基金的费用与税收

#### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、本基金从 C 类基金份额基金的财产中计提销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、账户开户费用和账户维护费；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.40\% \times \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对《新沃通利纯债债券型证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、更新了重要提示中本招募说明书所载内容截止日、有关财务数据和净值截止日的相关信息；
- 2、更新了三、基金管理人中基金管理人的相关信息；
- 3、更新了四、基金托管人中基金托管人的相关信息；
- 4、更新了五、相关服务机构中直销机构相关信息；
- 5、更新了六、基金的募集中基金募集相关信息；
- 6、更新了七、基金合同的生效中基金合同生效相关信息；
- 7、更新了十、基金的投资组合报告，并经托管人复核；
- 8、更新了十一、基金的业绩，并经托管人复核；
- 9、更新了二十三、其他披露事项，列示了本基金自上次招募说明书以来的公告事项。

新沃基金管理有限公司

2017 年 8 月