

新沃通宝货币市场基金 2017 年半年度报告

2017-06-30

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2017-08-29

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 2017 年 08 月 25 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

新沃通宝货币市场基金

基金简称

新沃通宝

场内简称

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

2015-10-20

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

3,196,039,840.98

基金合同存续期

不定期

下属 2 级基金的基金简称

新沃通宝 A

新沃通宝 B

下属 2 级基金的场内简称

下属 2 级基金的交易代码

001916

002302

报告期末下属 2 级基金的份额总额

1,079,696,150.26

2,116,343,690.72

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

本基金将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。

下属分级基金的风险收益特征

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

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

其他相关资料

项目

名称

办公地址

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

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期

报告期(2017-01-01 至 2017-06-30)

新沃通宝

新沃通宝 A

新沃通宝 B

本期已实现收益

7,215,409.18

41,942,987.92

本期利润

7,215,409.18

41,942,987.92

加权平均基金份额本期利润

本期加权平均净值利润率

-%

-%

-%

本期基金份额净值增长率

-%

-%

-%

本期净值收益率

-%

1.7357 %

1.8555 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

新沃通宝

新沃通宝 A

新沃通宝 B

期末可供分配利润

期末可供分配基金份额利润

期末基金资产净值

1,079,696,150.26

2,116,343,690.72

期末基金份额净值

1.0000

1.0000

报告期末

报告期末(2017-06-30)

新沃通宝

新沃通宝 A

新沃通宝 B

基金份额累计净值增长率

-%

-%

-%

累计净值收益率

-%

4.6083 %

3.0177 %

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。

2、本基金收益分配按日结转份额。

基金净值表现

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 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

过去一个月

0.3195 %

0.0032 %

0.1110 %

0.0000 %

0.2085 %

0.0032 %

过去三个月

0.9229 %

0.0024 %

0.3366 %

0.0000 %

0.5863 %

0.0024 %

过去六个月

1.7357 %

0.0022 %

0.6695 %

0.0000 %

1.0662 %

0.0022 %

过去一年

3.0037 %

0.0034 %

1.3500 %

0.0000 %

1.6537 %

0.0034 %

自基金合同生效起至今

4.6083 %

0.0032 %

2.2932 %

0.0000 %

2.3151 %

0.0032 %

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 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

过去一个月

0.3390 %

0.0032 %

0.1110 %

0.0000 %

0.2280 %

0.0032 %

过去三个月

0.9825 %

0.0024 %

0.3366 %

0.0000 %

0.6459 %

0.0024 %

过去六个月

1.8555 %

0.0022 %

0.6695 %

0.0000 %

1.1860 %

0.0022 %

自基金合同生效起至今

3.0177 %

0.0035 %

1.2205 %

0.0000 %

1.7972 %

0.0035 %

自基金合同生效以来基金份额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份额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

基金管理人及基金经理情况

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，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“专业创造价值，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。

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期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

俞璠

本基金的基金经理

2016-12-02

-

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。

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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

回顾过去半年，工业生产平稳、外需持续改善，从总体上带动了经济体的超预期增长，市场情绪谨慎，债市承压；金融监管政策密集出台，货币政策首次采用“稳健中性”的表达方式，监管机构去杠杆意图明显，债市波动加剧，短端收益再次踏上近期高点；而从4月末5月初开始，监管协调缓和了债券市场的情绪，随着央行在6月投放较多流动性，做多情绪充分释放，债市收益率迎来一波下行。

流动性方面，一季度央行通过公开市场回笼资金，降低公开市场操作的频率与节奏，同时两次上调公开市场操作利率，使得7天逆回购利率由2.25%上行至2.45%、14天逆回购利率由2.40%上行至2.60%，此外MLF的6个月利率水平由2.85%上调至3.05%、MLF的1年期利率由3.00%上调至3.20%，使得市场总体资金成本中枢上移，有效配合市场去杠杆。3月季末MPA考核将表外理财纳入广义信贷进行考核，使得市场资金利率有较明显上升，叠加同业存单集中到期等因素，债券市场资金面总体紧平衡。二季度初，货币市场利率回落，随着缴税、月末因素以及委外赎回传闻，4月下半月流动性开始收紧，5月银行理财增速下滑，同业存单存量在4月末达到高点后开始下降，金融去杠杆取得阶段性成果，货币政策削峰填谷平稳流动性，使得6月流动性总量较为宽裕，资金率下滑，同业存单发行利率在6月上旬达到高点后亦快速下滑。

2017年上半年，本基金在保证应对流动性的前提下，充分对比跟踪线上线下、场内场外、一级二级各种资产价格配置，以同业存单和协议存款作为主，同时适时配置1年以内有相对收益率溢价的短融和ABS以提高组合的收益率；并投资了较多的回购资产，同时密切跟踪持有人结构的变化，对申赎资金动向保持敏感，保持充足的流动性来应对赎回压力，适时调整久期和杠杆率。总体来看，组合在2017年上半年保持了较好的流动性和较稳定的收益率。

报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，新沃通宝 A 的基金份额净值收益率为 1.7357%，本报告期新沃通宝 B 的基金份额净值收益率为 1.8555%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，经济企稳信号增加，大宗商品价格处于相对高位，通胀预期上行，市场对经济数据已有部分预期且产生钝化，在金融去杠杆持续推进的背景下，货币政策预计仍将维持稳健中性。由于地方政府融资平台融资以及房地产投资受到政策打压，固定资产投资可能会有较为明显的下行压力；三驾马车中消费相对平稳，进出口方面，海外经济逐渐复苏，外需有所恢复；美欧货币政策趋紧也会对国内造成一定压力。同时，9 月同业存单到期量仍然较大，预计也会对资金面造成扰动。下半年收益率不具备进一步大幅上行的基础，趋势性下行空间的打开仍需要等待经济和融资的边际回落，债市调整趋势依旧。我们将根据经济基本面及政策面的变化，积极调整账户结构，优化组合配置。

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。

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 49,158,397.10 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 49,205,344.02 元，计入应付收益科目 371,012.97 元。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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。

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。

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

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，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、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，在各重要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 49,158,397.10 元。

托管人对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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

资产负债表

会计主体：新沃通宝货币市场基金

报告截止日：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

资产：

银行存款

93,233,206.10

744,067,739.93

结算备付金

-

-

存出保证金

1,311.01

-

交易性金融资产

1,190,671,001.35

1,380,542,967.35

其中：股票投资

-

-

基金投资

-

-

债券投资

1,180,819,001.35

1,380,542,967.35

资产支持证券投资

9,852,000.00

-

贵金属投资

-

-

衍生金融资产

-

-

买入返售金融资产

1,699,688,806.57

2,433,603,957.03

应收证券清算款

-

-

应收利息

7,075,653.69

7,628,263.28

应收股利

-

-

应收申购款

206,699,901.08

0.11

递延所得税资产

-

-

其他资产

-

-

资产总计

3,197,369,879.80

4,565,842,927.70

负债和所有者权益

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

负债：

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

-

194,940,587.58

应付证券清算款

-

-

应付赎回款

-

-

应付管理人报酬

544,962.50

792,826.86

应付托管费

82,570.06

120,125.28

应付销售服务费

186,058.12

34,875.64

应付交易费用

52,132.61

59,207.12

应交税费

-

-

应付利息

-

531,484.48

应付利润

371,012.97

417,959.89

递延所得税负债

-

-

其他负债

93,302.56

89,000.00

负债合计

1,330,038.82

196,986,066.85

所有者权益：

-

-

实收基金

3,196,039,840.98

4,368,856,860.85

未分配利润

-

-

所有者权益合计

3,196,039,840.98

4,368,856,860.85

负债和所有者权益总计

3,197,369,879.80

4,565,842,927.70

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3,196,039,840.98 份。

利润表

会计主体：新沃通宝货币市场基金

本报告期：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

一、收入

55,970,773.95

9,637,664.17

1.利息收入

55,859,407.56

9,226,006.46

其中：存款利息收入

7,199,476.77

1,352,193.32

债券利息收入

27,842,949.96

6,101,260.46

资产支持证券利息收入

778,475.96

-

买入返售金融资产收入

20,038,504.87

1,772,552.68

其他利息收入

-

-

2.投资收益（损失以“-”填列）

111,366.39

411,657.71

其中：股票投资收益

-

-

基金投资收益

-

-

债券投资收益

111,366.39

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）

-

-

减：二、费用

6,812,376.85

2,295,018.41

1. 管理人报酬

4,488,305.90

1,102,175.02

2. 托管费

680,046.31

166,996.21

3. 销售服务费

604,020.50

834,981.01

4. 交易费用

-

-

5. 利息支出

918,284.84

89,987.06

其中：卖出回购金融资产支出

918,284.84

89,987.06

6. 其他费用

121,719.30

100,879.11

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

49,158,397.10

7,342,645.76

减：所得税费用

-

-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）

49,158,397.10

7,342,645.76

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：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

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）

998,419,559.58

-

4,368,856,860.85

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

49,158,397.10

49,158,397.10

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）

-1,172,817,019.87

-

-1,172,817,019.87

其中：1.基金申购款

12,266,694,221.57

-

12,266,694,221.57

2.基金赎回款

-13,439,511,241.44

-

-13,439,511,241.44

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）

-

-49,158,397.10

-49,158,397.10

五、期末所有者权益（基金净值）

3,196,039,840.98

-

3,196,039,840.98

项目

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

-

4,368,856,860.85

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署；

基金管理人负责人：库三七 主管会计工作负责人：库三七 会计机构负责人：

马楠

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

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《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、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。

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》编制。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 01 月 01 日至 2017 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 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年 01 月 01 日至 2017 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。

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。

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。

记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

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。

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。

金融资产和金融负债的估值原则

为了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，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债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

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。

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。

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。

损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

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。

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。

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。

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。

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。

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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。

会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

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。

税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

活期存款

23,233,206.10

-

定期存款

70,000,000.00

-

其中：存款期限 1-3 个月

-

-

其中：存款期限 3-12 个月

70,000,000.00

-

其他存款

-

-

合计

93,233,206.10

744,067,739.93

注：定期存款的存款期限指票面存期

交易性金融资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

摊余成本

影子定价

偏离金额

偏离度（%）

债券

交易所市场

4,757,499.73

4,745,215.00

-12,284.73

-0.0004

银行间市场

1,176,061,501.62

1,177,378,600.00

1,317,098.38

0.0412

合计

1,180,819,001.35

1,182,123,815.00

1,304,813.65

0.0408

项目

上年度末

2016-12-31

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

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

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。

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

项目

上年度末

2016-12-31

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

注：无余额。

买入返售金融资产

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

2017-06-30

账面余额

其中：买断式逆回购

买入返售证券_银行间

1,262,363,806.57

-

买入返售证券_固定平台

437,325,000.00

-

合计

1,699,688,806.57

-

项目

上年度末

2016-12-31

账面余额

其中：买断式逆回购

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

项目

上年度末

2016-12-31

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：无余额。

应收利息

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应收活期存款利息

1,077.47

-

应收定期存款利息

729,516.42

-

应收其他存款利息

-

-

应收结算备付金利息

-

-

应收债券利息

5,316,455.16

-

应收买入返售证券利息

1,023,309.43

-

应收申购款利息

-

-

应收黄金合约拆借孳息

-

-

其他

5,295.21

-

合计

7,075,653.69

7,628,263.28

其他资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

其他应收款

-

-

待摊费用

-

-

合计

-

-

注：无余额。

应付交易费用

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

交易所市场应付交易费用

-

-

银行间市场应付交易费用

52,132.61

-

合计

52,132.61

59,207.12

其他负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应付券商交易单元保证金

-

-

应付赎回费

-

-

预提费用

93,302.56

-

合计

93,302.56

89,000.00

实收基金

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

新沃通宝 A

新沃通宝 B

基金份额（份）

账面金额

基金份额（份）

账面金额

上年度末

98,675,064.28

98,675,064.28

4,270,181,796.57

4,270,181,796.57

本期申购

4,463,569,732.96

4,463,569,732.96

7,803,124,488.61

7,803,124,488.61

本期赎回（以“-”号填列）

-3,482,548,646.98

-3,482,548,646.98

-9,956,962,594.46

-9,956,962,594.46

本期末

1,079,696,150.26

1,079,696,150.26

2,116,343,690.72

2,116,343,690.72

注：申购含红利再投、级别调整入份额；赎回含级别调整出份额。

未分配利润

新沃通宝 A

单位：人民币元

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

7,215,409.18

-

7,215,409.18

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

-7,215,409.18

-

-7,215,409.18

本期末

-

-

-

新沃通宝 B

单位：人民币元

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

41,942,987.92

-

41,942,987.92

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

-41,942,987.92

-

-41,942,987.92

本期末

-

-

-

存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

活期存款利息收入

62,174.12

-

定期存款利息收入

7,121,816.53

-

其他存款利息收入

-

-

结算备付金利息收入

15,479.99

-

其他

6.13

-

合计

7,199,476.77

1,352,193.32

注： 截止到 2017 年 6 月 30 日，本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况。

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出股票成交总额

-

-

减：卖出股票成本总额

-

-

买卖股票差价收入

-

-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

111,366.39

-

债券投资收益——赎回差价收入

-

-

债券投资收益——申购差价收入

-

-

合计

111,366.39

411,657.71

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额

4,934,440,017.13

-

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

4,913,091,457.55

-

减：应收利息总额

21,237,193.19

-

买卖债券差价收入

111,366.39

-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

赎回基金份额对价总额

-

-

减：现金支付赎回款总额

-

-

减：赎回债券成本总额

-

-

减：赎回债券应收利息总额

-

-

赎回差价收入

-

-

注：无。

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

申购基金份额对价总额

-

-

减：现金支付申购款总额

-

-

减：申购债券成本总额

-

-

减：申购债券应收利息总额

-

-

申购差价收入

-

-

注：无。

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-

-

减：卖出资产支持证券成本总额

-

-

减：应收利息总额

-

-

资产支持证券投资收益

-

-

注：无。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出权证成交总额

-

-

减：卖出权证成本总额

-

-

买卖权证差价收入

-

-

注：无。

衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间收益金额

2016-01-01 至 2016-06-30

国债期货投资收益

-

-

股指期货-投资收益

-

-

注：无。

股利收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

股票投资产生的股利收益

-

-

基金投资产生的股利收益

-

-

合计

-

-

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

1.交易性金融资产

-

-

——股票投资

-

-

——债券投资

-

-

——资产支持证券投资

-

-

——基金投资

-

-

——贵金属投资

-

-

——其他

-

-

2.衍生工具

-

-

——权证投资

-

-

3.其他

-

-

合计

-

-

注：无。

其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

基金赎回费收入

-

-

合计

-

-

注：无。

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

交易所市场交易费用

-

-

银行间市场交易费用

-

-

合计

-

-

注：无。

其他费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

审计费用

44,630.98

-

信息披露费

39,671.58

-

其他

1,689.90

-

账户服务费

18,000.00

-

银行费用

17,726.84

-

合计

121,719.30

100,879.11

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。

或有事项、资产负债表日后事项的说明

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。

资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

关联方关系

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

-

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、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。

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：无。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：无。

权证交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：无。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

关联方名称

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

注：无。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的管理费

4,488,305.90

1,102,175.02

其中：支付销售机构的客户维护费

82,601.15

25,638.06

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。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的托管费

680,046.31

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。

销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

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

481,243.71

112,786.29

594,030.00

合计

481,243.71

112,786.29

594,030.00

获得销售服务费的各关联方名称

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期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

779,990.39

-

779,990.39

合计

779,990.39

-

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 X0.25%/当年天数。

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

2017-01-01 至 2017-06-30

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

民生银行股份有限公司

-

-

140,000,000.00

165,238.36

-

-

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

各关联方投资本基金的情况

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

份额级别

新沃通宝 A

新沃通宝 B

新沃通宝 A

新沃通宝 B

基金合同生效日（2015-10-20）持有的基金份额

-

-

-

-

期初持有的基金份额

28,125,463.28

51,795,552.08

-

-

期间申购/买入总份额

-

43,822,384.68

517,699.58

-

期间因拆分增加的份额

-

-

-

-

减：期间赎回/卖出总份额

-

55,950,000.00

27,400,035.00

-

期末持有的基金份额

-

39,667,936.76

28,125,463.28

51,795,552.08

期末持有的基金份额占基金总份额比例

-%

1.87 %

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。

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

项目

新沃通宝 A

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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

2,231,163.73

0.21 %

-

-%

新沃资本控股集团有限公司

-

-%

-

-%

项目

新沃通宝 B

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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 %

新沃资本控股集团有限公司

31,412,977.78

1.48 %

97,253,058.75

2.28 %

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

期末余额

当期利息收入

期末余额

当期利息收入

中国民生银行-活期存款

23,233,206.10

62,174.12

1,579,938.90

25,302.45

中国民生银行-定期存款

0.00

752,888.94

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。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

注：无。

其他关联交易事项的说明

注：无。

利润分配情况

利润分配情况——货币市场基金新沃通宝 A

单位：人民币元

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

7,103,490.46

-

111,918.72

7,215,409.18

-

利润分配情况——货币市场基金新沃通宝 B

单位：人民币元

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

42,101,853.56

-

-158,865.64

41,942,987.92

-

期末（2017-06-30）本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

受限证券类别：股票

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

受限证券类别：债券

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：无。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码

股票名称

停牌日期

停牌原因

期末估值单价

复牌日期

复牌开盘单价

数量（股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：无。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

-

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

注：无。

交易所市场债券正回购

注：无。

金融工具风险及管理

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。

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交通银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司。因而与上述银行存款相关的信用风险均不重大。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，违约风险很小。

于 2017 年 06 月 30 日，本基金持有的资产支持证券余额为 9,852,000.00 元。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。

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

A-1

-

-

A-1 以下

-

-

未评级

1,135,030,000.00

1,210,218,058.49

合计

1,135,030,000.00

1,210,218,058.49

注： 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、同业存单、短期融资债券。

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

AAA

42,348,600.00

-

AAA 以下

4,745,215.00

-

未评级

-

170,324,908.86

合计

47,093,815.00

170,324,908.86

注：未评级债券为政策性金融债、同业存单、短期融资债券。

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和限制投资集中度来进行管理。本基金主要投资于银行间市场，除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

流动性净额

-

上年度末

2016-12-31

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

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。

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。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

6个月以内

6个月-1年

不计息

合计

资产

银行存款

-6,766,793.90

100,000,000.00

-

93,233,206.10

存出保证金

1,311.01

-

-

1,311.01

交易性金融资产

1,022,558,477.94

158,260,523.41

9,852,000.00

1,190,671,001.35

买入返售金融资产

1,262,358,000.00

-

-

1,262,358,000.00

应收利息

-

-

7,075,653.69

7,075,653.69

应收申购款

-

-

206,699,901.08

206,699,901.08

其他资产

-

-

437,330,806.57

437,330,806.57

资产总计

2,278,150,995.05

258,260,523.41

660,958,361.34

3,197,369,879.80

负债

应付管理人报酬

-

-

544,962.50

544,962.50

应付托管费

-

-

82,570.06

82,570.06

应付销售服务费

-

-

186,058.12

186,058.12

应付交易费用

-

-

52,132.61

52,132.61

应付利润

-

-

371,012.97

371,012.97

其他负债

-

-

93,302.56

93,302.56

负债总计

-

-

1,330,038.82

1,330,038.82

利率敏感度缺口

2,278,150,995.05

258,260,523.41

659,628,322.52

3,196,039,840.98

上年度末

2016-12-31

6 个月以内

6个月-1年

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

1,438,020,000.00

-

-

1,438,020,000.00

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

-

-

995,583,957.03

995,583,957.03

资产总计

3,393,934,752.60

168,695,954.68

1,003,212,220.42

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

3,198,994,165.02

168,695,954.68

1,001,166,741.15

4,368,856,860.85

利率风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

注：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。

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。

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

项目

上期末

2016-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

外汇风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

公允价值

占基金资产净值比例（%）

公允价值

占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资

-

-

-

-

交易性金融资产—基金投资

-

-

-

-

交易性金融资产—债券投资

1,191,975,815.00

37.30

1,378,100,000.00

31.54

交易性金融资产—贵金属投资

-

-

-

-

衍生金融资产—权证投资

-

-

-

-

其他

-

-

-

-

合计

1,191,975,815.00

37.30

1,378,100,000.00

31.54

其他价格风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

采用风险价值法管理风险

-

假设

-

-

分析

风险价值（金额单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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

①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：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：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；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

②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 2017 年 06 月 30 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工具中属于第二层级的余额为人民币 1,180,819,001.35 元，无属于第一层级和第三层级的余额。于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本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级未发生重大变动。

③非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

④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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：①金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；② 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；③ 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。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。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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

1,190,671,001.35

37.24

其中：债券

1,180,819,001.35

36.93

资产支持证券

9,852,000.00

0.31

2

买入返售金融资产

1,699,688,806.57

53.16

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

93,233,206.10

2.92

4

其他各项资产

213,776,865.78

6.69

5

合计

3,197,369,879.80

100.00

债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号

项目

占基金总资产的比例 (%)

1

报告期内债券回购融资余额

1.93

其中：买断式回购融资

-

序号

项目

金额

占基金总资产的比例 (%)

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

注：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%。

基金投资组合平均剩余期限

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

45

报告期内投资组合平均剩余期限最高值

96

报告期内投资组合平均剩余期限最低值

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：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。

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

65.47

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

2

30 天(含)—60 天

4.68

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

3

60 天(含)—90 天

6.97

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

4

90 天(含)—120 天

1.55

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

5

120 天(含)—397 天（含）

14.68

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

合计

93.35

-

报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：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。

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

139,853,907.52

4.38

2

央行票据

-

-

3

金融债券

-

-

其中：政策性金融债

-

-

4

企业债券

4,757,499.73

0.15

5

企业短期融资券

349,929,518.22

10.95

6

中期票据

42,131,116.70

1.32

7

同业存单

644,146,959.18

20.15

8

其他

-

-

9

合计

1,180,819,001.35

36.95

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。

期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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

179915

17 贴现国债 15

1,100,000

109,965,380.16

3.44

2

011751027

17 兖州煤业 SCP001

800,000

79,973,083.64

2.50

3

011772009

17 陕煤化 SCP003

800,000

79,966,903.24

2.50

4

011753018

17 兖州煤业 SCP002

700,000

69,992,508.16

2.19

5

011698945

16 陕煤化 SCP012

500,000

49,981,322.55

1.56

6

111795082

17 山西尧都农商行 CD029

500,000

49,961,852.79

1.56

7

111795252

17 瑞丰银行 CD032

500,000

49,943,639.48

1.56

8

111790390

17 重庆农村商行 CD015

500,000

49,918,235.18

1.56

9

111790362

17 泸州商行 CD003

500,000

49,914,596.60

1.56

10

111719023

17 恒丰银行 CD023

500,000

49,733,473.34

1.56

“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

0.0584 %

报告期内偏离度的最低值

-0.0878 %

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

0.0421 %

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号

发生日期

偏离度

原因

调整期

注：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

序号

发生日期

偏离度

原因

调整期

注：本报告期内未发现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

金额单位：人民币元

序号

证券代码

证券名称

数量（份）

公允价值

占基金资产净值比例（%）

1

1789066

17 捷赢 1A

950,000

5,852,000.00

0.18

2

1789023

17 招金 1A2

100,000

4,000,000.00

0.13

投资组合报告附注

基金计价方法说明

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。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

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

1,311.01

2

应收证券清算款

-

3

应收利息

7,075,653.69

4

应收申购款

206,699,901.08

5

其他应收款

-

6

待摊费用

-

7

其他

-

8

合计

213,776,865.78

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。

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

48,691

22,174.45

26,473,912.81

2.45 %

1,053,222,237.45

97.55 %

新沃通宝 B

39

54,265,222.84

2,036,168,476.35

96.21 %

80,175,214.36

3.79 %

合计

48,730

65,586.70

2,062,642,389.16

64.54 %

1,133,397,451.81

35.46 %

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

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

1,589,817.78

0.15 %

新沃通宝 B

-

-%

合计

1,589,817.78

0.05 %

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

10~50

新沃通宝 B

0

合计

10~50

本基金基金经理持有本开放式基金

新沃通宝 A

0~10

新沃通宝 B

0

合计

0~10

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

-

-%

-

-%

-

开放式基金份额变动

单位：份

项目

新沃通宝

新沃通宝 A

新沃通宝 B

基金合同生效日（2015-10-20）基金份额总额

-

200,063,654.31

本报告期期初基金份额总额

-

98,675,064.28

4,270,181,796.57

本报告期期间总申购份额

-

4,463,569,732.96

7,803,124,488.61

本报告期期间基金总赎回份额

-

3,482,548,646.98

9,956,962,594.46

本报告期期末基金份额总额

3,196,039,840.98

1,079,696,150.26

2,116,343,690.72

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。

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。

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，邢凯先生已离任本公司副总经理职务，丁平先生担任本公司副总经理职务，具体信息请参见基金管理人于 2017 年 4 月 22 日披露的《新沃基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。

基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

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。

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。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

基金交易

债券交易

债券回购交易

权证交易

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

成交金额

占当期基金成交总额的比例

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

佣金

占当期佣金总量的比例

方正证券

2

-

-%

-

-%

14,826,372.57

100.00 %

722,000,000.00

100.00 %

-

-%

254.02

100.00 %

-

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、本报告期内租用证券公司交易单元变更情况：无。 -

偏离度绝对值超过 0.5%的情况

项目

发生日期

偏离度

法定披露报刊

法定披露日期

报告期内偏离度绝对值在 0.5%（含）以上

-

-

-

-

注：本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

其他重大事件

序号

公告事项

法定披露方式

法定披露日期

0

新沃基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞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

2017-01-05

1

新沃基金管理有限公司关于增加北京格上富信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

2017-01-12

2

新沃通宝货币市场基金 2016 年第 4 季度报告

指定报刊和/或管理人网站

2017-01-21

3

新沃基金管理有限公司关于增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为代销机构的公告

指定报刊和/或管理人网站

2017-02-15

4

新沃基金管理有限公司关于增加上海长量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

2017-02-28

5

新沃基金管理有限公司关于增加凤凰金信（银川）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

2017-03-16

6

新沃基金管理有限公司关于增加南京苏宁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

2017-03-20

7

新沃通宝货币市场基金 2016 年年度报告

指定报刊和/或管理人网站

2017-03-31

8

新沃通宝货币市场基金 2016 年年度报告 摘要

指定报刊和/或管理人网站

2017-03-31

9

新沃基金管理有限公司关于增加北京晟视天下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

2017-04-20

10

新沃通宝货币市场基金 2017 年第 1 季度报告

指定报刊和/或管理人网站

2017-04-22

11

新沃通宝货币市场基金暂停大额申购业务的公告

指定报刊和/或管理人网站

2017-04-25

12

新沃通宝货币市场基金 2017 年“端午节”假期前暂停代销机构大额申购业务的公告

指定报刊和/或管理人网站

2017-05-23

13

新沃基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大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

2017-06-14

14

新沃基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉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

2017-06-14

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

2017/1/1-2017/3/7

992,051,382.96

0.00

992,051,382.96

0.00

0.000000 %

2

2017/4/6-2017/5/3

351,152,819.78

750,000,000.00

1,054,333,093.13

50,000,000.00

1.570000 %

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

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。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流动性较好的短期固定收益类证券为主。本基金采用摊余成本法进行估值，在市场条件不利的情况下，单一投资者赎回本基金可能扩大本基金影子价格法估值与摊余成本法估值的负偏离度，公司对负偏离度的调整可能给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。

存放地点

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所。

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。

