

新沃通宝货币市场基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十三日

§ 1 重要提示

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 2019 年 8 月 21 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。

本年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	2,544,384,995.78 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	468,559,244.38 份	2,075,825,751.40 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。

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	刘小舫	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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.sinvofund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	新沃通宝 A	新沃通宝 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	8,096,215.28	48,835,885.03
本期利润	8,096,215.28	48,835,885.03
本期净值收益率	1.3377%	1.4587%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	468,559,244.38	2,075,825,751.40
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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。

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
过去一个月	0.2573%	0.0055%	0.1110%	0.0000%	0.1463%	0.0055%
过去三个月	0.6354%	0.0034%	0.3366%	0.0000%	0.2988%	0.0034%
过去六个月	1.3377%	0.0031%	0.6695%	0.0000%	0.6682%	0.0031%
过去一年	3.0767%	0.0042%	1.3500%	0.0000%	1.7267%	0.0042%
过去三年	10.4315%	0.0035%	4.0500%	0.0000%	6.3815%	0.0035%
自基金合同生效起至今	12.1518%	0.0035%	4.9932%	0.0000%	7.1586%	0.0035%

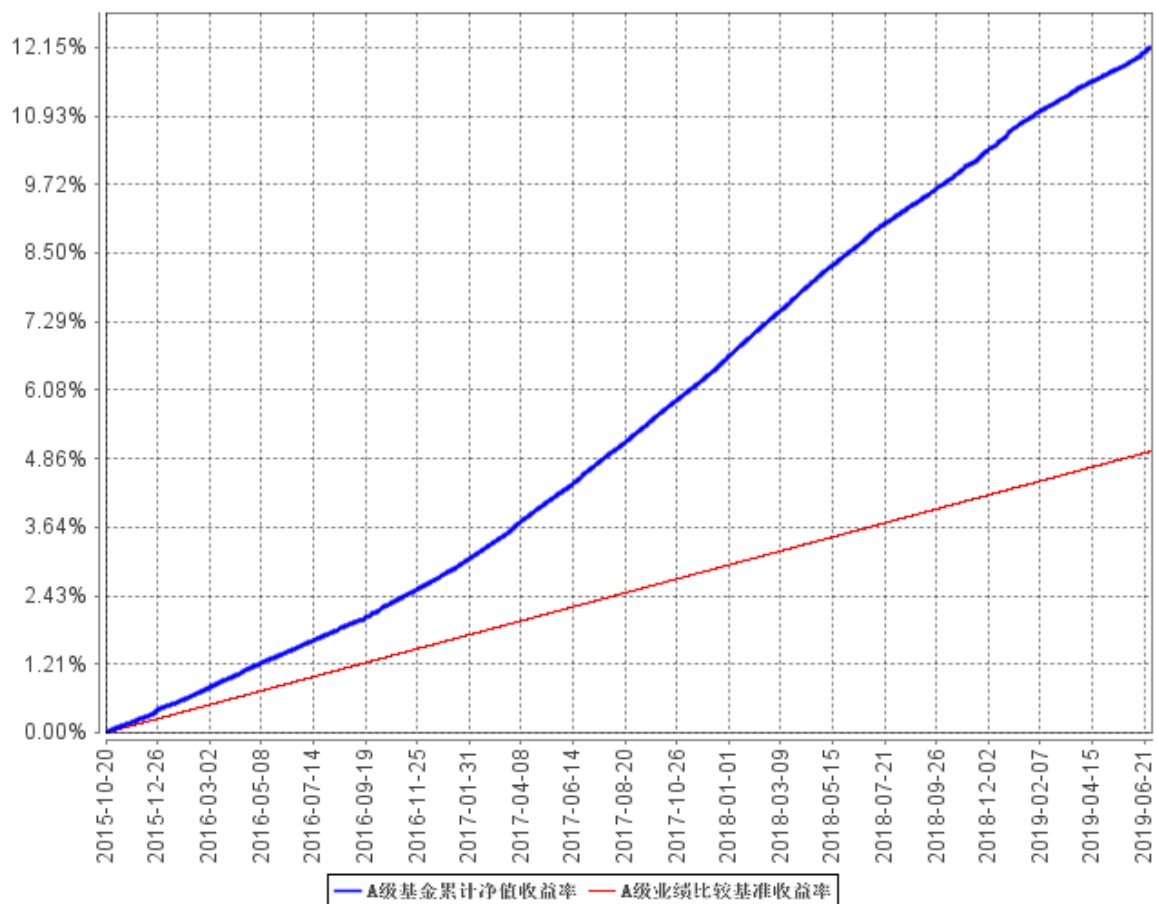
新沃通宝 B

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
过去一个月	0.2770%	0.0055%	0.1110%	0.0000%	0.1660%	0.0055%
过去三个月	0.6958%	0.0034%	0.3366%	0.0000%	0.3592%	0.0034%
过去六个月	1.4587%	0.0031%	0.6695%	0.0000%	0.7892%	0.0031%
过去一年	3.3252%	0.0042%	1.3500%	0.0000%	1.9752%	0.0042%

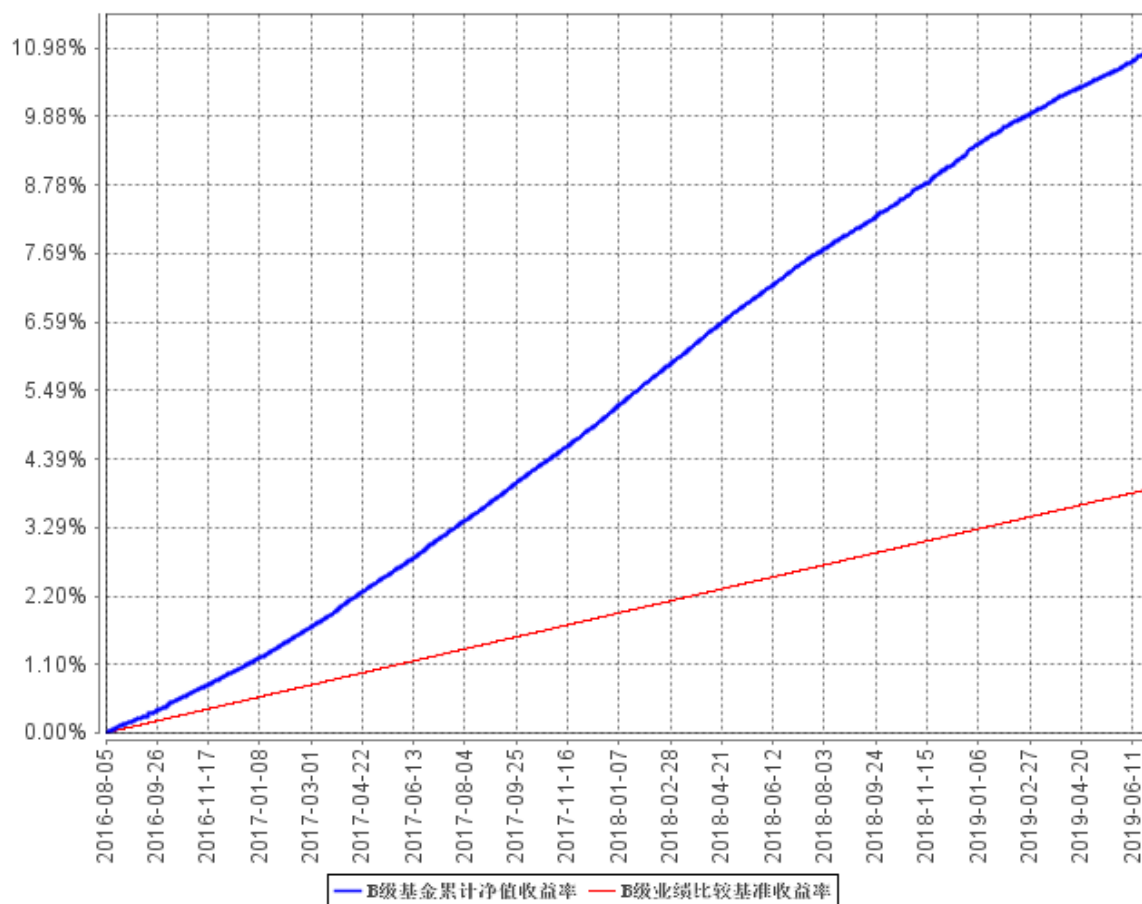
自基金合同 生效起至今	10.9785%	0.0035%	3.9205%	0.0000%	7.0580%	0.0035%
----------------	----------	---------	---------	---------	---------	---------

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



§ 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，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		
俞璩	本基金的基金经理	2016 年 12 月 2 日	-	6 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 月加入新沃基金管理有限公司。

注：1、上述任职日期、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循《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**4.3.1 公平交易制度的执行情况**

为公平对待投资者，保护投资者利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做出明确具体的规定。本报告期内，本基金管理人严格执行相关规定，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不公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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**

本基金一季度保持了相对较高久期，二季度主动降低了资产比例与久期，保持充足流动性应对半年末。同时针对监管要求，在季节性时点增强流动性、不间断进行负债端流动性审查和匹配、持续跟踪持仓信用安全、定期进行压力测试，保证了账户的平稳运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期新沃通宝 A 的基金份额净值收益率为 1.3377%，本报告期新沃通宝 B 的基金份额净值收益率为 1.4587%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年，基本面数据总体疲弱，流动性依然宽松。从货币市场具体来看，R007 长期低位，仅在季末时点有波动抬升。市场方面 6 月末信用分层现象明显，最终在央行的干预下有所好转，期间利率债及高等级信用债走势明显优于中低等级信用债。隔夜资金加权利率一度低于 1%，创造近期历史新低。同业存单市场上，股份制银行发行收益率快速下行，作为标杆的 3 个月股份制同业存单利率降至 2.5%，季末效应明显弱化，而机构申购依旧踊跃。

未来政策或继续在减税及财政投放上发力，而货币政策考虑到目前流动性充裕的状态或将维持不变，长期来看应更注重基本面数据和企业盈利的变化。总体而言，短期内货币市场流动性充裕的环境大概率维持，同时考虑到短端资产收益率水平处于历史低位，或将迎来一定的反弹。

4.6 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。

4.7 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 56,932,100.31 元。

4.8 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

本基金本报告期末出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《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、基金费用开支及利润分配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。

5.3 托管人对本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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新沃通宝货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	11,238,889.82	171,235,526.55
结算备付金		655,522.06	11,745,454.55

存出保证金		5,292.06	321.50
交易性金融资产	6.4.7.2	1,692,855,716.61	1,780,023,922.74
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,642,450,753.50	1,720,017,424.27
资产支持证券投资		50,404,963.11	60,006,498.47
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	774,525,108.64	747,934,016.90
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	19,184,901.07	12,582,454.68
应收股利		-	-
应收申购款		47,384,274.71	13,656,439.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,545,849,704.97	2,737,178,136.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	292,398,921.40
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		764,076.25	824,985.50
应付托管费		115,769.12	124,997.78
应付销售服务费		113,212.48	186,310.76
应付交易费用	6.4.7.7	72,393.37	60,408.21
应交税费		98,203.58	92,143.57
应付利息		-	251,244.04
应付利润		184,189.44	257,626.40
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	116,864.95	139,000.00
负债合计		1,464,709.19	294,335,637.66
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,544,384,995.78	2,442,842,498.68
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,544,384,995.78	2,442,842,498.68
负债和所有者权益总计		2,545,849,704.97	2,737,178,136.34

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,544,384,995.78 份，其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 468,559,244.38 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

2,075,825,751.40 份。

6.2 利润表

会计主体：新沃通宝货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		67,482,669.52	83,940,255.07
1.利息收入		65,781,342.43	83,008,706.22
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,918,846.02	7,025,914.21
债券利息收入		38,758,380.79	49,449,700.02
资产支持证券利息收入		1,511,030.15	2,266,530.80
买入返售金融资产收入		21,593,085.47	24,266,561.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,466,598.33	931,548.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,477,720.34	881,207.58
资产支持证券投资	6.4.7.13.3	-11,122.01	50,341.27
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	234,728.76	-
减：二、费用		10,550,569.21	10,462,207.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,670,022.99	5,881,064.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,010,609.55	891,070.40
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	924,460.03	2,564,362.79
4. 交易费用	6.4.7.19	-	150.00
5. 利息支出		1,751,444.12	981,240.48
其中：卖出回购金融资产支出		1,751,444.12	981,240.48
6. 税金及附加		40,701.53	25,239.15
7. 其他费用	6.4.7.20	153,330.99	119,080.21
三、利润总额（亏损总额以“-”		56,932,100.31	73,478,047.17

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		56,932,100.31	73,478,047.17

6.3 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：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	2,442,842,498.68	-	2,442,842,498.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	56,932,100.31	56,932,100.31
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）	101,542,497.10	-	101,542,497.10
其中：1. 基金申购款	15,165,081,766.53	-	15,165,081,766.53
2. 基金赎回款	-15,063,539,269.43	-	-15,063,539,269.43
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）	-	-56,932,100.31	-56,932,100.31
五、期末所有者权益（基金净值）	2,544,384,995.78	-	2,544,384,995.78
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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）	4,175,333,772.54	-	4,175,333,772.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	73,478,047.17	73,478,047.17

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）	-1,077,079,843.86	-	-1,077,079,843.86
其中：1. 基金申购款	9,385,369,833.86	-	9,385,369,833.86
2. 基金赎回款	-10,462,449,677.72	-	-10,462,449,677.72
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）	-	-73,478,047.17	-73,478,047.17
五、期末所有者权益（基金净值）	3,098,253,928.68	-	3,098,253,928.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 易勇	_____ 易勇	_____ 马楠
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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(以下简称“新沃基金”),基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)。

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。当投资者在单个基金账

户保留的 A 类基金份额达到 B 类基金份额的最低份额（500 万份）要求时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户保留的 A 类基金份额全部升级为 B 类基金份额；当投资者在单个基金账户保留的 B 类基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户保留的 B 类基金份额全部降级为 A 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。

根据《关于新沃通宝货币市场基金取消自动升降级业务的公告》并报证监会备案，本基金于 2019 年 5 月 16 日取消不同基金份额类别的自动升降级业务，即当投资者在单个基金账户保留的 A 类基金份额达到 B 类基金份额的最低份额（500 万份）要求时，本基金的注册登记机构不再自动将其在该基金账户保留的 A 类基金份额全部升级为 B 类基金份额；当投资者在单个基金账户保留的 B 类基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构不再自动将其在该基金账户保留的 B 类基金份额全部降级为 A 类基金份额。投资者当日持有份额减少导致在同一交易账户保留的 A 类基金份额不足 0.01 份的，同一交易账户保留 B 类基金份额不足 500 万份的，登记机构将全部剩余份额自动赎回。

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。

6.4.2 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 6.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 01 月 01 日至 2019 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 2019 年 06 月 30 日的财务状况以及 2019 年 01 月 01 日至 2019 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。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的

适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	11,238,889.82
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	11,238,889.82

注：定期存款的存款期限指票面存期

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 6 月 30 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	1,642,450,753.50	1,644,833,500.00	2,382,746.50	0.0936%
	合计	1,642,450,753.50	1,644,833,500.00	2,382,746.50	0.0936%
资产支持证券		50,404,963.11	50,309,000.00	-95,963.11	-0.0038%
合计		1,692,855,716.61	1,695,142,500.00	2,286,783.39	0.0898%

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	355,434,000.00	—
银行间市场	419,091,108.64	—
合计	774,525,108.64	—

注：于 2019 年 6 月 30 日，交易所买入返售证券余额中包含的交易所固收平台质押式协议回购的余额为人民币 355,434,000.00 元。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	920.47
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	6,190.00
应收债券利息	15,708,191.06
应收资产支持证券利息	816,196.91
应收买入返售证券利息	2,653,400.23
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	2.40
合计	19,184,901.07

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,197.18
银行间市场应付交易费用	71,196.19
合计	72,393.37

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	116,864.95
合计	116,864.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

新沃通宝 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	785,334,586.21	785,334,586.21
本期申购	386,670,578.67	386,670,578.67
本期赎回(以“-”号填列)	-703,445,920.50	-703,445,920.50
— 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	468,559,244.38	468,559,244.38

金额单位：人民币元

新沃通宝 B		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,657,507,912.47	1,657,507,912.47
本期申购	14,778,411,187.86	14,778,411,187.86
本期赎回(以“-”号填列)	-14,360,093,348.93	-14,360,093,348.93
— 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	2,075,825,751.40	2,075,825,751.40

注：申购含红利再投份额。

6.4.7.10 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	8,096,215.28	-	8,096,215.28
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	-8,096,215.28	-	-8,096,215.28
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	48,835,885.03	-	48,835,885.03
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	-48,835,885.03	-	-48,835,885.03
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,050.86
定期存款利息收入	3,783,405.57
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	100,382.61
其他	6.98
合计	3,918,846.02

注：于 2019 年半年度，本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况。

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,477,720.34
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	1,477,720.34

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,832,750,575.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,775,439,914.21
减：应收利息总额	55,832,940.64
买卖债券差价收入	1,477,720.34

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	123,320,693.93
减：卖出资产支持证券成本总额	119,696,389.91
减：应收利息总额	3,635,426.03
资产支持证券投资收益	-11,122.01

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	—
其他收入-违约金收入	234,728.76
合计	234,728.76

6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	58,276.38
其他	963.90
账户服务费	18,000.00
银行费用	26,502.14
合计	153,330.99

6.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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	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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,670,022.99	5,881,064.87
其中：支付销售机构的客户维护费	1,531,018.92	1,687,524.32

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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,010,609.55	891,070.40

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。

6.4.9.2.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	688,059.85	110,785.77	798,845.62
合计	688,059.85	110,785.77	798,845.62

获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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	2,478,283.69	74,166.49	2,552,450.18
合计	2,478,283.69	74,166.49	2,552,450.18

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 = 前一日某类基金份额基金资产净值 × 该类基金份额约定年费率 / 当年天数。

6.4.9.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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
中国民生银行	-	-	-	-	665,900,000.00	60,428.90
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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
中国民生银行	-	-	-	-	58,500,000.00	4,636.92

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	82,937.65	-
期间申购/买入总份额	5,003,604.34	-

期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	1,000,000.00	-
期末持有的基金份额	4,086,541.99	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.87%	-

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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	-	22,211,185.93
期间申购/买入总份额	3,272,585.52	10,956,933.17
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	2,800,000.00	33,168,119.10
期末持有的基金份额	472,585.52	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.03%	-

注：1、期间申购总份额含红利再投。

2、基金管理人新沃基金在本年度申购和赎回本基金的交易委托新沃基金直销中心办理，无申购费和赎回费。

6.4.9.4.2 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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	-	-	15,108.53	0.00%
新沃资本控股集团有限公司	1,803,207.65	0.38%	-	-

新沃通宝 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	-	-	-	-
新沃资本控股集团有限公司	59,858,061.74	2.88%	62,684,068.49	3.78%

6.4.9.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	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	11,238,889.82	35,050.86	66,017,305.77	27,916.23
中国民生银行-定期存款	-	-	235,000,000.00	1,854,166.51

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。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 1,000,000 张中国民生银行的同业存单，成本总额为人民币 99,813,663.10 元，估值总额为人民币 99,880,000.00 元，成本占基金资产净值的比例为 3.9194%。

6.4.10 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.11 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 2019 年 6 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资产中属于第二层次的余额 1,692,855,716.61 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(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期变动金额

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有的第三层次金融资产。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 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。

(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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,692,855,716.61	66.49
	其中：债券	1,642,450,753.50	64.51
	资产支持证券	50,404,963.11	1.98
2	买入返售金融资产	774,525,108.64	30.42
	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	11,894,411.88	0.47
4	其他各项资产	66,574,467.84	2.62
5	合计	2,545,849,704.97	100.00

7.2 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	4.20	
	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	—	—
	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报告期内每个交易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

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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49
-------------------	----

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过 120 天的情形。

7.3.2 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	45.25	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天(含)—60 天	13.13	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天(含)—90 天	3.13	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天(含)—120 天	15.92	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	120 天(含)—397 天(含)	20.01	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
合计		97.44	—

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过 240 天的情形。

7.5 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	100,025,436.36	3.93
2	央行票据	—	—
3	金融债券	70,017,570.93	2.75
	其中：政策性金融债	70,017,570.93	2.75
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	610,410,682.91	23.99
6	中期票据	150,600,363.52	5.92
7	同业存单	711,396,699.78	27.96
8	其他	—	—
9	合计	1,642,450,753.50	64.55

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。

7.6 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	011802332	18 云能投 SCP008	1,100,000	110,098,970.61	4.33
2	101654101	16 津城建 MTN004	1,000,000	100,170,117.24	3.94
3	160016	16 付息国债 16	1,000,000	100,025,436.36	3.93
4	111809313	18 浦发银行 CD313	1,000,000	99,873,503.41	3.93
5	111815349	18 民生银行 CD349	1,000,000	99,813,663.10	3.92
6	011900696	19 冀中能源 SCP004	800,000	80,013,940.13	3.14
7	011900131	19 远东租赁 SCP001	800,000	80,004,745.77	3.14
8	180209	18 国开 09	700,000	70,017,570.93	2.75
9	111916158	19 上海银行 CD158	700,000	69,905,920.60	2.75
10	111905069	19 建设银行 CD069	700,000	69,615,208.87	2.74

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

7.7 “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	0.1377%
报告期内偏离度的最低值	0.0183%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0753%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 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

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	139248	万科 26A1	300,000	30,174,588.36	1.19
2	156093	PR10A1	600,000	14,752,134.21	0.58
3	1989094	19 上和 2A1	100,000	5,292,239.46	0.21
4	1989013	19 上和 1A1	300,000	186,001.08	0.01

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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的情况的说明

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.9.3 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	5,292.06
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	19,184,901.07
4	应收申购款	47,384,274.71
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	66,574,467.84

7.9.4 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	101,978	4,594.71	61,678,791.88	13.16%	406,880,452.50	86.84%
新沃通宝 B	51	40,702,465.71	2,074,888,313.36	99.95%	937,438.04	0.05%
合计	102,029	24,937.86	2,136,567,105.24	83.97%	407,817,890.54	16.03%

注：分级基金机构、个人投资者持有份额占总份额的比例中，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）。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	基金类机构	213,664,797.84	8.40%
2	券商类机构	194,642,879.22	7.65%
3	券商类机构	152,345,198.57	5.99%
4	基金类机构	113,077,210.11	4.44%
5	券商类机构	101,127,356.65	3.98%
6	券商类机构	100,120,061.07	3.94%
7	券商类机构	99,965,126.52	3.93%
8	券商类机构	91,963,363.88	3.61%
9	其他机构	71,298,234.78	2.80%
10	其他机构	61,661,269.39	2.42%

8.3 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	2,481,443.58	0.5296%
	新沃通宝 B	937,299.98	0.0452%
	合计	3,418,743.56	0.1344%

8.4 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	10~50
	新沃通宝 B	50~100
	合计	>100
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

§ 9 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	785,334,586.21	1,657,507,912.47
本报告期期间基金总申购份额	386,670,578.67	14,778,411,187.86
减：本报告期期间基金总赎回份额	703,445,920.50	14,360,093,348.93
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	468,559,244.38	2,075,825,751.40

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 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、基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	-	-	6,907.71	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。

10.7.2 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	121,453,675.83	100.00%	10,677,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

本基金本报告期内不存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

11.2 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。

新沃基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日