

新沃通宝货币市场基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 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

报告送出日期：二〇一九年十月二十四日

§ 1 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 23 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 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	新沃通宝	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	2, 718, 486, 091. 00 份	
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。	
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	
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	385, 371, 626. 56 份	2, 333, 114, 464. 44 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年7月1日—2019年9月30日）	
	新沃通宝 A	新沃通宝 B
1. 本期已实现收益	2,502,991.82	16,326,104.82
2. 本期利润	2,502,991.82	16,326,104.82
3. 期末基金资产净值	385,371,626.56	2,333,114,464.44

注：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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	0.6172%	0.0034%	0.3403%	0.0000%	0.2769%	0.0034%

注：本基金收益分配按日结转份额。

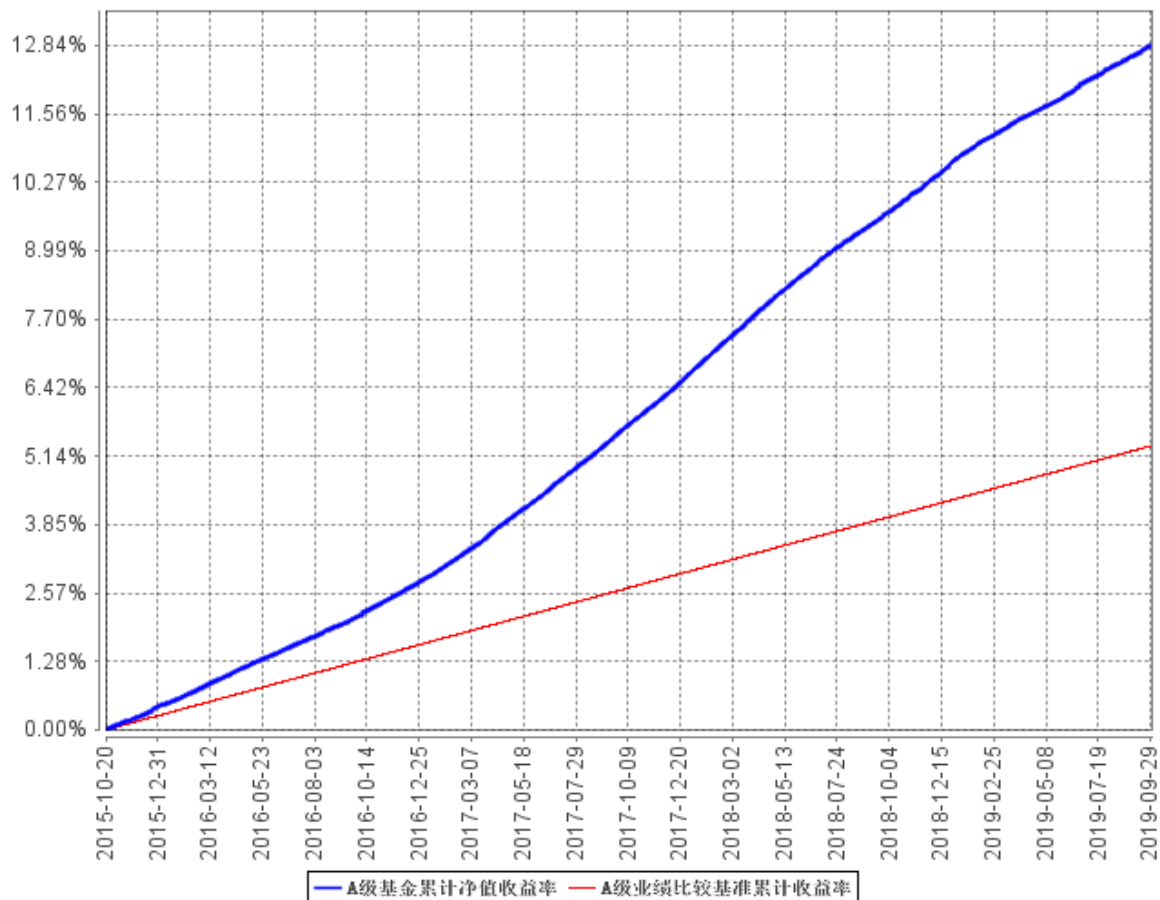
新沃通宝 B

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
过去三个月	0.6783%	0.0034%	0.3403%	0.0000%	0.3380%	0.0034%

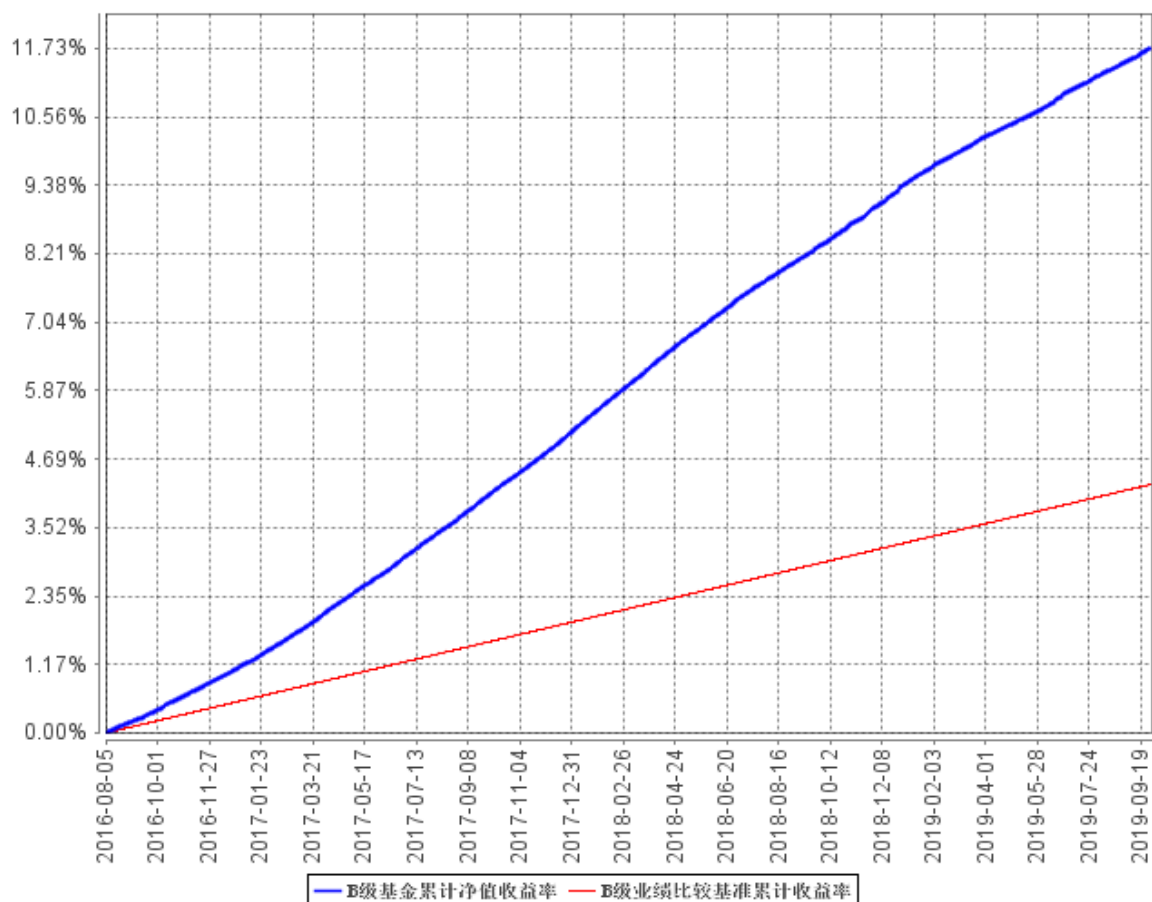
注：本基金收益分配按日结转份额。

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



注：本报告期内，本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 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		
俞璪	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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年三季度，基本面数据总体疲弱，流动性中性宽松。从货币市场具体来看，R007 较前两季度略有一定提升，短债与回购利差降低。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。同业存单市场上，作为标杆的 3 个月股份制同业存单利率一度提升至 2.80%，存款驻足于 2.85%，季末效应相对上一季度明显。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与 CPI、汇率方面的掣肘，或将维持中性不变，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，资金利率大概率震荡，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。考虑到资金利率提升有效降低了机会成本，短融与 CD 利差降至相对低点，本账户期间保持了较高的流动性，信用方面主要以配置股份制银行 CD 和存款为主，在保证流动性的同时争取获得更高的收益率。

4.5 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 0.6172%，本报告期新沃通宝 B 的基金份额净值收益率为 0.6783%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

4.6 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 投资组合报告

5.1 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	固定收益投资	1,310,397,288.76	48.14
	其中：债券	1,278,797,215.00	46.98
	资产支持证券	31,600,073.76	1.16
2	买入返售金融资产	951,642,430.75	34.96
	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	428,412,752.51	15.74
4	其他资产	31,611,655.33	1.16
5	合计	2,722,064,127.35	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	2.80	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	2,177,876.73	0.08
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	49
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	79
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

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。

5.3.2 报告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	48.93	0.08
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	12.17	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	26.82	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	5.15	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	5.90	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	98.97	0.08

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,898,281.37	5.18
	其中: 政策性金融债	140,898,281.37	5.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	500,080,906.99	18.40
6	中期票据	100,063,830.95	3.68
7	同业存单	537,754,195.69	19.78
8	其他	-	-
9	合计	1,278,797,215.00	47.04
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。

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	111916188	19 上海银行 CD188	1,500,000	149,889,735.03	5.51
2	101654101	16 津城建 MTN004	1,000,000	100,063,830.95	3.68
3	011901398	19 杭商贸 SCP001	1,000,000	100,004,102.95	3.68
4	011901506	19 陕投集团 SCP006	1,000,000	99,998,511.50	3.68
5	111812210	18 北京银行 CD210	1,000,000	99,677,830.37	3.67
6	111803212	18 农业银行 CD212	1,000,000	99,405,189.06	3.66

7	170205	17 国开 05	900,000	90,541,600.64	3.33
8	011900696	19 冀中能源 SCP004	700,000	70,006,055.00	2.58
9	111910425	19 兴业银行 CD425	600,000	59,627,692.18	2.19
10	011900749	19 伊利实业 SCP002	500,000	50,040,904.60	1.84

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1035%
报告期内偏离度的最低值	0.0604%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0834%

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绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139248	万科 26A1	300,000.00	30,043,046.98	1.10
2	1989094	19 上和 2A1	100,000.00	1,557,026.78	0.06

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,185.70
2	应收证券清算款	51,550.71
3	应收利息	17,435,094.63
4	应收申购款	14,119,824.29
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	31,611,655.33

5.9.4 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新沃通宝 A	新沃通宝 B
报告期期初基金份额总额	468,559,244.38	2,075,825,751.40
报告期期间基金总申购份额	160,098,267.88	5,225,017,434.92
报告期期间基金总赎回份额	243,285,885.70	4,967,728,721.88
报告期期末基金份额总额	385,371,626.56	2,333,114,464.44

注：表内“总申购份额”含红利再投份额。

§ 7 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
1	申购	2019年7月3日	2,000,000.00	2,000,000.00	-
2	赎回	2019年7月12日	-500,000.00	-500,000.00	-
3	赎回	2019年7月19日	-1,500,000.00	-1,500,000.00	-
4	赎回	2019年7月30日	-400,000.00	-400,000.00	-
5	赎回	2019年8月14日	-50,000.00	-50,000.00	-
6	赎回	2019年8月20日	-1,200,000.00	-1,200,000.00	-
7	赎回	2019年9月20日	-600,000.00	-600,000.00	-
8	申购	2019年9月27日	3,800,000.00	3,800,000.00	-
9	红利再投资	-	22,695.81	22,695.81	-
合计			1,572,695.81	1,572,695.81	

注：本基金的收益分配按日结转份额，列示在“红利再投资”项下一并披露。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《新沃通宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《新沃通宝货币市场基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

新沃基金管理有限公司

2019 年 10 月 24 日