

新沃通利纯债债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 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.....	48
7.7 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.....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	48
7.9 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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.11 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55

§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新沃通利纯债债券型证券投资基金	
基金简称	新沃通利纯债	
基金主代码	003664	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 27 日	
基金管理人	新沃基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,695,033.59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	新沃通利纯债 A	新沃通利纯债 C
下属分级基金的交易代码:	003664	003665
报告期末下属分级基金的份额总额	11,639,476.91 份	55,556.68 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过主要配置公司债券、企业债券等固定收益类金融工具，追求资产的长期稳定增值，力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用期限匹配下的主动性投资策略，主要包括：类属资产配置策略、期限结构策略、久期调整策略、个券选择策略、分散投资策略及资产支持证券等品种投资策略等投资管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种固定收益品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等预期风险/收益的产品。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王靖飞
	联系电话	400-698-9988
	电子邮箱	service@sinvofund.com
客户服务电话	400-698-9988	95559
传真	010-58290555	021-62701216
注册地址	山东省青岛市崂山区苗岭路 15 号青岛金融中心大厦 702 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址	北京市朝阳区创远路 36 号院 8 号楼 5 层 D2 区域	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	100012	200336
法定代表人	朱灿	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.sinvofund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 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	北京市朝阳区创远路 36 号院 8 号楼 5 层 D2 区域

§ 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	新沃通利纯债 A	新沃通利纯债 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	96,658.47	600.92
本期利润	33,418.45	56.80
加权平均基金份额本期利润	0.0030	0.0006
本期加权平均净值利润率	0.28%	0.05%
本期基金份额净值增长率	0.27%	0.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	511,087.74	1,792.85
期末可供分配基金份额利润	0.0439	0.0323
期末基金资产净值	12,365,530.03	58,420.93
期末基金份额净值	1.0624	1.0516
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	12.42%	13.35%

注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

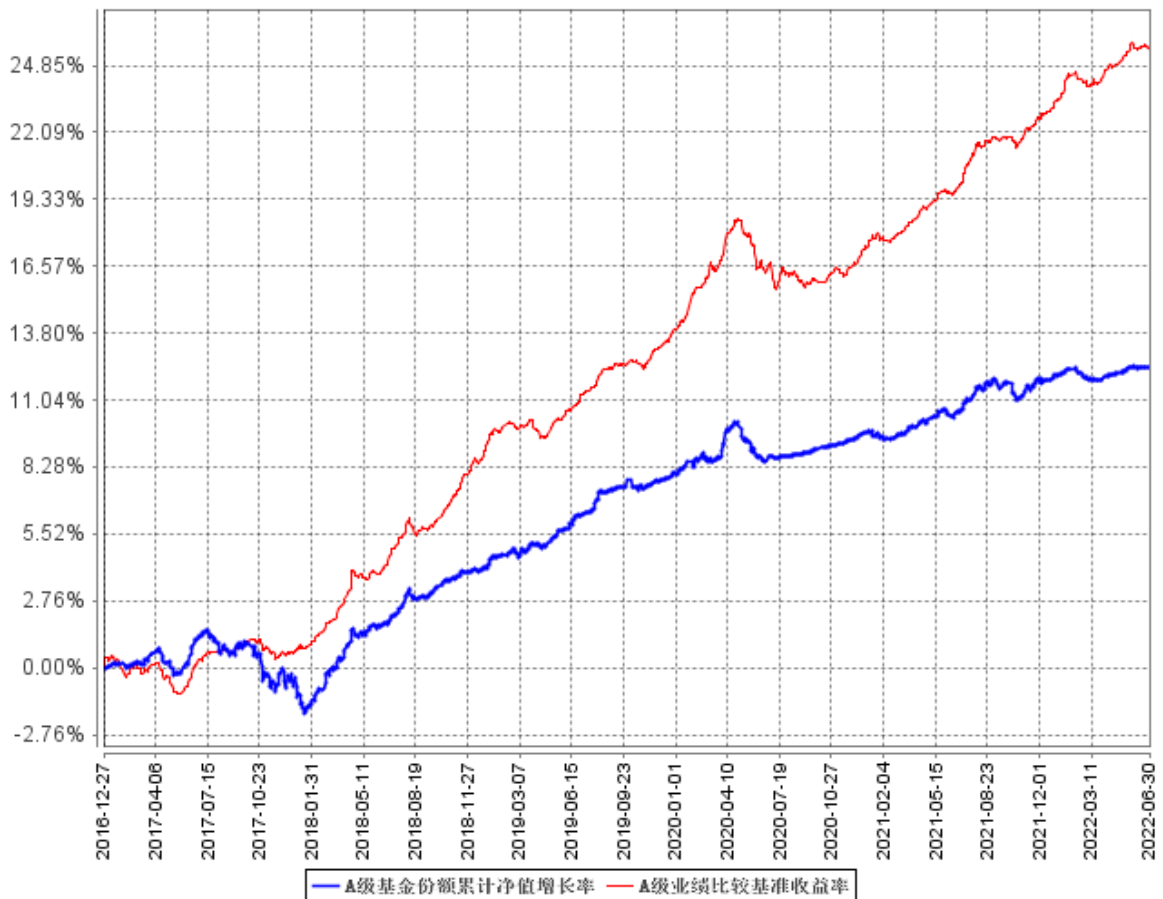
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.00%	0.01%	-0.01%	0.02%	0.01%	-0.01%
过去三个月	0.45%	0.02%	1.05%	0.04%	-0.60%	-0.02%
过去六个月	0.27%	0.03%	1.83%	0.05%	-1.56%	-0.02%
过去一年	1.66%	0.05%	4.78%	0.05%	-3.12%	0.00%
过去三年	5.79%	0.05%	13.20%	0.07%	-7.41%	-0.02%
自基金合同生效起至今	12.42%	0.07%	25.62%	0.07%	-13.20%	0.00%

新沃通利纯债 C

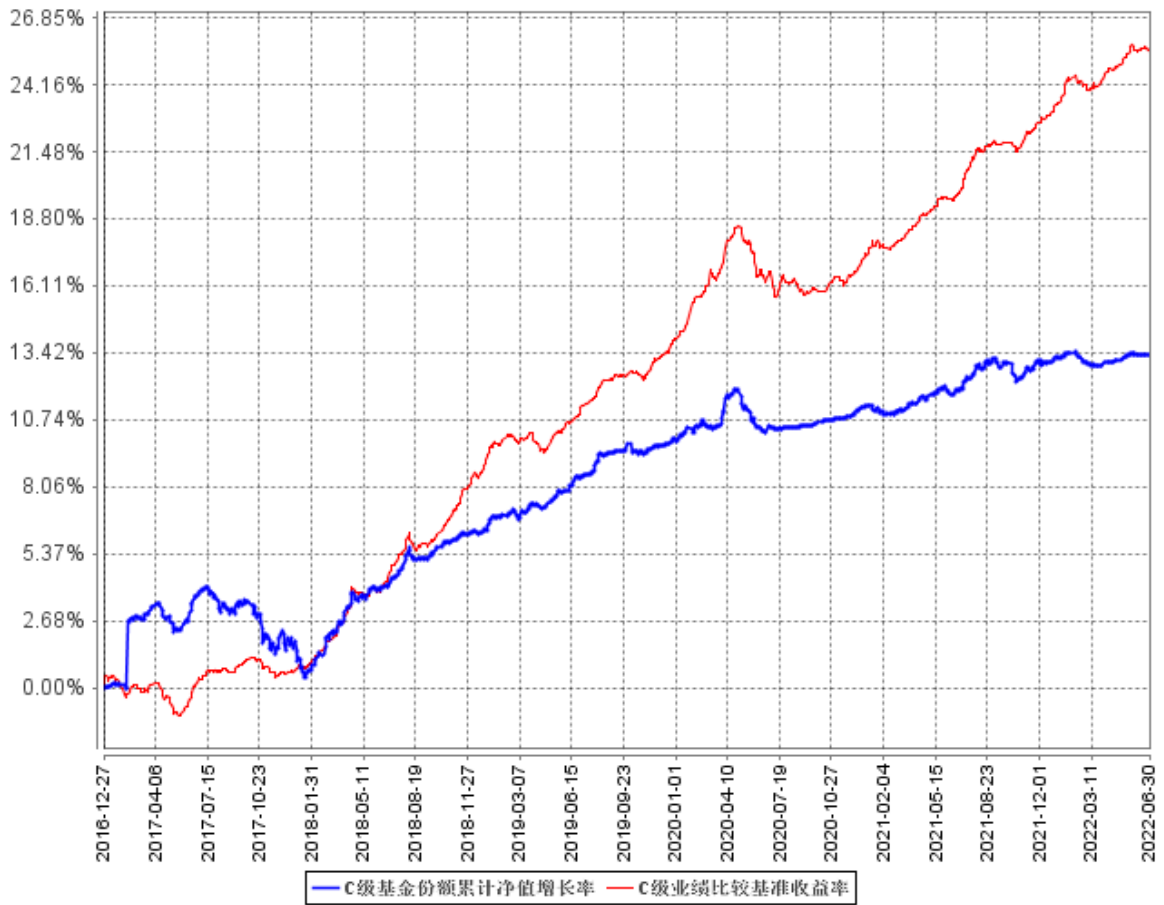
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.03%	0.02%	-0.01%	0.02%	-0.02%	0.00%
过去三个月	0.36%	0.02%	1.05%	0.04%	-0.69%	-0.02%
过去六个月	0.08%	0.03%	1.83%	0.05%	-1.75%	-0.02%
过去一年	1.25%	0.05%	4.78%	0.05%	-3.53%	0.00%
过去三年	4.54%	0.05%	13.20%	0.07%	-8.66%	-0.02%
自基金合同生效起至今	13.35%	0.10%	25.62%	0.07%	-12.27%	0.03%

3.2.2 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级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则，本基金选取“中债综合指数收益率”作为本基金的比较基准。

§ 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，经营范围包括公募基金管理业务、证券投资基金销售服务和中国证监会许可的其他业务。截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 6 只公募基金，分别是新沃通宝货币市场基金、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、新沃创新领航混合型证券投资基金、新沃内需增长混合型证券投资基金、新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金。

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。

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		
沈夏	本基金的基金经理	2020 年 7 月 7 日	-	6 年	上海复旦大学硕士，中国籍。2015 年 7 月至 2016 年 12 月任职于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司，担任结算业务部经理助理；2016 年 12 月加入新沃基金，先后担任固定收益部研究员、投资经理，现担任基金经理。

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、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《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。

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《新沃基金管理有限公司公平交易管理办法》，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实，确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

2022 年上半年，基本面来看，经济下行压力仍然较大，但是预期略有企稳。从经济数据来看，CPI 符合预期，PPI 同比延续下滑，通胀压力进一步缓解。投资和生产数据远超预期。工业增加值和 PMI 继续回暖，房地产开发投资、基建投资、制造业投资增长等数据亮眼。出口继续高企，但是增速略有下滑。出口偏高会对经济形成支撑，出口越高，政策稳增长压力越小，出口在为内需回暖争取时间。二季度受到疫情影响，复苏放缓，经济继续走弱，CPI 和 PPI 整体可控并且在预期范围之内，生产端方面，5 月国内疫情逐步收敛，经济活动有所恢复，PMI 回升体现复苏将至，但仍需政策发力。而需求端方面，投资、地产、消费等均较弱，地产仍然处于下行周期，后续关注地产先行指标如开发贷、销售数据等的恢复斜率。出口仍然维持了相对强劲势头，但是面对国内疫情冲击、出口新订单下降和地缘政治不确定性，后续出口呈现出有一定下行风险。

从债券市场来看，上半年债券受到基本面、资金面、疫情、海外市场等多种因素的影响，收益率呈现出震荡下行的趋势。一季度初始，社融和贷款数据不及预期，市场对于松地产、宽信用产生了怀疑，叠加深圳和上海疫情严重，债券收益率一度下行。中旬，受到 1 月社融超预期的数据影响，叠加广州下调房贷利率等一些地产放松的政策带来了情绪影响，加上临近税期流动性边际收敛带来的短期扰动，利率债收益率震荡上行。3 月份利率债总体宽幅震荡，长短端走势略出现分化，尤其长端上行幅度较大。市场对于消息面和数据引起的波动较为剧烈。债券市场方面，二季度利率债收益率总体震荡下行。4 月前半月，市场交易了资金面宽松的逻辑，利率大幅下行。后受到通胀略超预期、社融/贷款略超预期、中美利差 12 年首次出现倒挂等利空因素的影响，收

益率有所上行，而国常会宣布适时运用降准等货币政策工具，向实体经济合理让利，降低综合融资成本，利率债显现出震荡走势。5 月份市场多空因素交织，市场对消息比较钝化和犹豫。多头关注资金面宽松、基本面复苏不及预期、曲线持续保持陡峭。空头关注宽信用政策持续升温、经济复苏方向确定、美联储加息给国内货币政策空间的压制。6 月份，利率债收益率在疫情逐步得到控制、复工复产稳步推进、稳增长举措成效显现等多重因素作用下，叠加美国 5 月通胀飙升，美债收益率大幅走高，中美利差再次扩大压制国内现券情绪，曲线窄幅震荡上行。

信用债方面，市场抢券严重，信用债市场几乎全线收涨。在流动性传导依旧较慢的情况下，机构配置压力依旧较大，其中是中短久期信用债需求较大，期限利差趋于陡峭。资产荒的背后是疫情冲击之下宽信用渠道受阻，资金堆积银行间体系，流动性泛滥，同时前期股灾打压风险偏好，资金扎堆票息资产，5、6 月份开始，短期利率已经处于历史低点，投资者为获得更好的票息开始拉长久期，向久期要收益，并适度增加杠杆。

考虑到经济向上修复和流动性逐步回归常态化，本基金主要以短期利率债为主，同时采用票息策略继续配置部分高等级信用债，并在合适的时间窗口配置部分银行存款以增厚收益。上半年降低久期，减仓超长期利率债，降低组合的净值波动。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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末新沃通利纯债 A 基金份额净值为 1.0624 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.27%；截至本报告期末新沃通利纯债 C 基金份额净值为 1.0516 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.08%；同期业绩比较基准收益率为 1.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年债市上涨的逻辑主要还是资金面较为宽松，部分地区疫情反复，经济修复的进程仍然偏慢。当前处于债牛的后半段，国内经济进入恢复期，海外美国进入加息周期，宽货币+宽信用组合使得收益率曲线趋于陡峭化。展望三季度，市场预期利率会出现调整，但对于幅度和节奏则有所分歧。货币政策目标在于促进经济回归合理区间，目标在于宽信用，下半年仍然有可能保持流动性略高于合理充裕，但是如果宽信用的进程加快并出现起色，央行很可能在货币投放上就会有所收紧。目前稳增长力度总体仍然有限，叠加三重压力与疫情反复状态，下一阶段，债市重点继续关注货币政策和财政政策，以及经济修复动能的持续性与稳定性。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况；本基金于 2022 年 1 月 4 日至 2022 年 6 月 30 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会报告并提出解决方案，本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§ 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，基金托管人在新沃通利纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，新沃基金管理有限公司在新沃通利纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由新沃基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关新沃通利纯债债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：新沃通利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,147,196.76	911,310.58
结算备付金		162,924.27	153,545.93
存出保证金		806.41	1,226.20
交易性金融资产	6.4.7.2	11,175,187.54	10,302,943.10
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		11,175,187.54	10,302,943.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	200,028.82	350,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	45,490.72
应收股利		-	-
应收申购款		100.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	220,695.64
资产总计		13,686,243.80	11,985,212.17
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		1,200,090.80	200,000.00
应付清算款		8,644.37	50,000.00

应付赎回款		-	5,431.35
应付管理人报酬		5,114.84	5,372.43
应付托管费		1,022.96	1,074.48
应付销售服务费		19.20	35.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,003.98	244.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	46,396.69	34,000.00
负债合计		1,262,292.84	296,158.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	11,695,033.59	11,033,009.77
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	728,917.37	656,043.50
净资产合计		12,423,950.96	11,689,053.27
负债和净资产总计		13,686,243.80	11,985,212.17

(1) 报告截止日 2022 年 6 月 30 日，新沃通利纯债 A 基金份额净值 1.0624 元，基金份额总额 11,639,476.91 份；新沃通利纯债 C 基金份额净值 1.0516 元，基金份额总额 55,556.68 份。新沃通利纯债份额总额合计为 11,695,033.59 份。

(2) 以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期/年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期/年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：新沃通利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		108,226.64	206,481.76
1.利息收入		27,784.76	255,569.03
其中：存款利息收入	6.4.7.13	24,133.14	12,013.60
债券利息收入		-	233,772.01
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		3,651.62	9,783.42
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		144,153.91	2,210.35
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	144,153.91	2,210.35
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-63,784.14	-51,433.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	72.11	135.70
减：二、营业总支出		74,751.39	81,158.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	29,762.68	40,186.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,952.54	8,037.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	210.72	228.86
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,240.33	1,812.99
其中：卖出回购金融资产支出		7,240.33	1,812.99
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		488.43	77.78
8. 其他费用	6.4.7.23	31,096.69	30,815.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,475.25	125,322.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,475.25	125,322.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		33,475.25	125,322.87

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期/年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期/年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新沃通利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	11,033,009.77	-	656,043.50	11,689,053.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	11,033,009.77	-	656,043.50	11,689,053.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	662,023.82	-	72,873.87	734,897.69
（一）、综合收益总额	-	-	33,475.25	33,475.25
（二）、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）	662,023.82	-	39,398.62	701,422.44
其中：1.基金申购款	1,066,096.09	-	61,993.03	1,128,089.12
2.基金赎回款	-404,072.27	-	-22,594.41	-426,666.68
（三）、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)				
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	11,695,033.59	-	728,917.37	12,423,950.96
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	16,175,717.67	-	596,298.49	16,772,016.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	16,175,717.67	-	596,298.49	16,772,016.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-928,102.86	-	90,726.17	-837,376.69
(一)、综合收益总额	-	-	125,322.87	125,322.87
(二)、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)	-928,102.86	-	-34,596.70	-962,699.56
其中：1.基金申购款	13,325.54	-	487.96	13,813.50
2.基金赎回款	-941,428.40	-	-35,084.66	-976,513.06
(三)、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)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	15,247,614.81	-	687,024.66	15,934,639.47

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：

邢凯 邢凯 孙娟
 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

新沃通利纯债债券型证券投资基金（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”）证监许可第[2016]1599号《关于准予新沃通利纯债债券型证券投资基金注册的批复》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《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同》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 613,732,070.81 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（2016）第 947 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 613,909,342.32 份基金份额，其中认购资金利息折合 177,271.51 份基金份额。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”），基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

根据《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《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》和基金合同等有关规定，本基金的投资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）。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产 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，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

本基金的财务报表于 2022 年 8 月 29 日已经本基金的基金管理人批准报出。

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颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 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 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的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分

类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

① 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

a) 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

b) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金目前暂无以公允价值计量且其变动计入当期损益的债务工具。

② 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后

续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(5) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.4 费用的确认和计量

(1) 本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提；

(2) 本基金的托管费按《基金合同》约定的方法进行计提；

(3) 本基金的 C 类基金份额 的销售服务费 按以《基金合同》约定的方法进行计提；

(4) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

(5) 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。

(6) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

(1) 以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 911,310.58 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,533.46 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 914,844.04 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 153,545.93 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 38.39 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的

账面价值为人民币 153,584.32 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,226.20 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.55 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,226.75 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 350,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币-56.02 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 349,943.98 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 220,695.64 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 3,533.46 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 155.88 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 0.55 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 217,061.77 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币-56.02 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

(2)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,302,943.1 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 217,061.77 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,520,004.87 元。

(3)以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 200,000.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 0 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 200,000.00 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《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号文《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号文《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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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。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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。上述所得统一适用20%的税率

计征个人所得税。

(4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

(5)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。

(6)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

(7)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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	21,403.98
等于：本金	21,400.05
加：应计利息	3.93
减：坏账准备	-
定期存款	2,125,792.78
等于：本金	2,100,000.00
加：应计利息	25,792.78
减：坏账准备	-
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	2,125,792.78
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计：	2,147,196.76

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	11,027,303.57	213,754.94	11,175,187.54	-65,870.97
	银行间市场	-	-	-	-
合计		11,027,303.57	213,754.94	11,175,187.54	-65,870.97
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		11,027,303.57	213,754.94	11,175,187.54	-65,870.97

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	200,028.82	-
银行间市场	-	-
合计	200,028.82	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	46,396.69
合计	46,396.69

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

新沃通利纯债 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	10,930,433.02	10,930,433.02
本期申购	945,414.33	945,414.33
本期赎回(以“-”号填列)	-236,370.44	-236,370.44
- 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	11,639,476.91	11,639,476.91

金额单位：人民币元

新沃通利纯债 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	102,576.75	102,576.75
本期申购	120,681.76	120,681.76
本期赎回(以“-”号填列)	-167,701.83	-167,701.83
- 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	55,556.68	55,556.68

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

新沃通利纯债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	385,849.07	264,978.57	650,827.64
本期利润	96,658.47	-63,240.02	33,418.45
本期基金份额交易产生的变动数	28,580.20	13,226.83	41,807.03
其中：基金申购款	37,912.70	17,962.09	55,874.79
基金赎回款	-9,332.50	-4,735.26	-14,067.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	511,087.74	214,965.38	726,053.12

单位：人民币元

新沃通利纯债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,655.28	2,560.58	5,215.86
本期利润	600.92	-544.12	56.80
本期基金份额交易产生的变动数	-1,463.35	-945.06	-2,408.41
其中：基金申购款	3,210.95	2,907.29	6,118.24
基金赎回款	-4,674.30	-3,852.35	-8,526.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,792.85	1,071.40	2,864.25

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	480.04
定期存款利息收入	22,292.78
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	661.70
其他	698.62
合计	24,133.14

注：其他为结算保证金及期货保证金利息收入。

6.4.7.13 股票投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益**6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	213,710.77
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-69,556.86
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	144,153.91

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	11,405,343.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,145,446.30
减：应计利息总额	329,399.71
减：交易费用	53.87
买卖债券差价收入	-69,556.86

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.16 贵金属投资收益

无。

6.4.7.17 衍生工具收益

无。

6.4.7.18 股利收益

无。

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-63,784.14
——股票投资	-
——债券投资	-63,784.14
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-63,784.14

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	72.11
合计	72.11

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，对持续持有期内的投资人收取的不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	600.00
帐户维护费	18,000.00
银行费用	100.00
合计	31,096.69

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

无。

6.4.9.2 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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,762.68	40,186.21
其中：支付销售机构的客户维护费	3,161.14	4,050.81

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,952.54	8,037.22

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	新沃通利纯债 A	新沃通利纯债 C	合计
新沃基金管理有限公司	-	13.20	13.20
交通银行股份有限公司	-	3.62	3.62
合计	-	16.82	16.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	新沃通利纯债 A	新沃通利纯债 C	合计
新沃基金管理有限公司	-	14.16	14.16
交通银行股份有限公司	-	3.62	3.62
合计	-	17.78	17.78

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给新沃基金管理有限公司，再由新沃基金管理有限公司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 C 类基金份额基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	新沃通利纯债 A	新沃通利纯债 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 27 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,908,835.18	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	8,908,835.18	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	76.1800%	-

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	新沃通利纯债 A	新沃通利纯债 C
基金合同生效日（2016 年	-	-

12 月 27 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	12,438,835.18	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减: 报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	12,438,835.18	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	81.5800%	-

6.4.10.5.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未投资本基金。

6.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
交通银行股份有限公司	21,403.98	480.04	48,271.44	899.94

注: 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管, 按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末 (2022 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,200,090.80 元，分别于 2022 年 7 月 1 日、7 月 4 日、7 月 5 日、7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，具有中等预期风险、中等预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于混合型基金和股票型基金、高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

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、风险管理委员会、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。

6.4.13.2 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的发行人出现违约、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存放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所场内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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场及证券交易所场外交易平台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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,164.62	4,085,887.80
合计	10,164.62	4,085,887.80

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	9,087,394.01	3,812,052.10
AAA 以下	312,390.23	-

未评级	1,765,238.68	2,405,003.20
合计	11,165,022.92	6,217,055.30

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评

估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因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关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,147,196.76	-	-	-	2,147,196.76
结算备付金	162,924.27	-	-	-	162,924.27
存出保证金	806.41	-	-	-	806.41
交易性金融资产	5,754,138.30	5,125,345.20	81,949.10	-	10,961,432.60
买入返售金融资产	200,028.82	-	-	-	200,028.82
应收申购款	-	-	-	100.00	100.00

其他资产	-	-	-	213,754.94	213,754.94
资产总计	8,265,094.56	5,125,345.20	81,949.10	213,854.94	13,686,243.80
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融 资产款	1,200,090.80	-	-	-	1,200,090.80
应付管理人报 酬	-	-	-	5,114.84	5,114.84
应付托管费	-	-	-	1,022.96	1,022.96
应付销售服务 费	-	-	-	19.20	19.20
应交税费	-	-	-	1,003.98	1,003.98
其他负债	-	-	-	55,041.06	55,041.06
负债总计	1,200,090.80	-	-	62,202.04	1,262,292.84
利率敏感度缺 口	7,065,003.76	5,125,345.20	81,949.10	151,652.90	12,423,950.96
上年度末 2021年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	911,310.58	-	-	-	911,310.58
结算备付金	153,545.93	-	-	-	153,545.93
存出保证金	1,226.20	-	-	-	1,226.20
交易性金融资 产	6,402,340.40	2,150,542.50	1,750,060.20	-	10,302,943.10
买入返售金融 资产	350,000.00	-	-	-	350,000.00
应收证券清算 款	-	-	-	45,490.72	45,490.72
应收利息	-	-	-	220,695.64	220,695.64
资产总计	7,818,423.11	2,150,542.50	1,750,060.20	266,186.36	11,985,212.17
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融 资产款	200,000.00	-	-	-	200,000.00
应付证券清算 款	-	-	-	50,000.00	50,000.00
应付赎回款	-	-	-	5,431.35	5,431.35
应付管理人报 酬	-	-	-	5,372.43	5,372.43
应付托管费	-	-	-	1,074.48	1,074.48
应付销售服务 费	-	-	-	35.95	35.95
应交税费	-	-	-	244.69	244.69
其他负债	-	-	-	34,000.00	34,000.00

负债总计	200,000.00	-	-	96,158.90	296,158.90
利率敏感度缺口	7,618,423.11	2,150,542.50	1,750,060.20	170,027.46	11,689,053.27

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	其他市场变量保持不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-30,190.48	-71,385.05
	市场利率下降 25 个基点	30,347.75	72,855.81

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。

6.4.13.4.2 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，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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、分散投资策略以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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本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 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，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	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	11,175,187.54	89.95	10,302,943.10	88.14
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	11,175,187.54	89.95	10,302,943.10	88.14

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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：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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	11,175,187.54	10,302,943.10
第三层次	-	-
合计	11,175,187.54	10,302,943.10

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券，若不存在活跃市场未经调整的报价（包括重大事项、新发未上市等原因所致），本基金不会将此类证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,175,187.54	81.65
	其中：债券	11,175,187.54	81.65
	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	200,028.82	1.46
	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	2,310,121.03	16.88
8	其他各项资产	906.41	0.01
9	合计	13,686,243.80	100.00

7.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末未持有股票。

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	1,208,266.12	9.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,545,883.06	12.44
	其中：政策性金融债	564,985.28	4.55
4	企业债券	8,256,175.70	66.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	164,862.66	1.33
10	合计	11,175,187.54	89.95

注：其他为地方政府债。

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019641	20 国债 11	9,000	921,860.88	7.42
2	149345	21 长江 01	7,500	772,587.99	6.22
3	122218	12 国航 01	7,000	723,822.44	5.83
4	163321	20 能源 04	5,000	511,375.92	4.12
5	163485	20 中冶 02	4,500	452,007.74	3.64

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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，本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。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金未持有股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.11.3 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	806.41
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	906.41

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 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
新沃通利纯债 A	514	22,644.90	8,909,782.51	76.55%	2,729,694.40	23.45%
新沃通利纯债 C	42	1,322.78	-	-	55,556.68	100.00%
合计	556	21,034.23	8,909,782.51	76.18%	2,785,251.08	23.82%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占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）。

8.2 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	新沃通利纯债 A	197.86	0.0017%
	新沃通利纯债 C	393.11	0.7076%
	合计	590.97	0.0051%

8.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	新沃通利纯债 A	0~10
	新沃通利纯债 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	新沃通利纯债 A	0
	新沃通利纯债 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新沃通利纯债 A	新沃通利纯债 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 27 日）基金份额总额	411,098,667.79	202,810,674.53
本报告期期初基金份额总额	10,930,433.02	102,576.75
本报告期基金总申购份额	945,414.33	120,681.76
减：本报告期基金总赎回份额	236,370.44	167,701.83
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	11,639,476.91	55,556.68

§ 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，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

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

本基金会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙）自 2020 年 11 月 19 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	
中银国际	2	-	-	-	-	-

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，在对证券公司综合评估的基础上，选择财务状况良好，经营行为规范，研究实力较强的证券公司，向其租用专用交易席位。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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：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
中银国际	14,333,404.72	100.00%	82,566,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	新沃通利纯债债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 1 月 21 日
2	新沃基金管理有限公司关于旗下基金新增基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 1 月 25 日
3	新沃基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 3 月 4 日
4	新沃通利纯债债券型证券投资基金 2021 年年度报告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 3 月 30 日
5	新沃基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 4 月 6 日
6	新沃基金管理有限公司关于旗下基金在部分销售机构暂停办理相关销售业务的公告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 4 月 18 日
7	新沃通利纯债债券型证券投资基金（新沃通利纯债 A 份额）基金产品资料概要（更新）	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 4 月 20 日
8	新沃通利纯债债券型证券投资基金（新沃通利纯债 C 份额）基金产品资料概要（更新）	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 4 月 20 日
9	新沃通利纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2022 年第 1 号）	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 4 月 20 日
10	新沃通利纯债债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 4 月 21 日
11	新沃基金管理有限公司关于终止部分销售机构代理销售本公司旗下基金的公告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 4 月 29 日

12	新沃基金管理有限公司关于旗下基金新增基金销售机构的公告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 5 月 6 日
13	新沃基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 6 月 13 日
14	新沃基金管理有限公司关于公司和直销中心办公地址变更的公告	指定报刊和/或管理人网站	2022 年 6 月 24 日

§ 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

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	2022/01/01-2022/06/30	8,908,835.18	0.00	0.00	8,908,835.18	76.18%
产品特有风险							
<p>(1) 赎回申请延期办理的风险 高比例投资者大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 当高比例投资者大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。</p> <p>(4) 提前终止基金合同的风险 高比例投资者赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予新沃通利纯债债券型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新沃通利纯债债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 《关于申请募集注册新沃通利纯债债券型证券投资基金之法律意见书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他备查文件

12.2 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，在办公时间内可供免费查阅。

12.3 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

2022年8月30日