

新沃通利纯债债券型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十四日

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	新沃通利纯债	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	6,673,402.68 份	
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。	
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	
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	6,591,000.93 份	82,401.75 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（2023年7月1日—2023年9月30日）	
	新沃通利纯债 A	新沃通利纯债 C
1. 本期已实现收益	3,733.69	-43.50
2. 本期利润	17,620.24	97.26
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0024	0.0012
4. 期末基金资产净值	7,123,771.74	87,713.71
5. 期末基金份额净值	1.0808	1.0645

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。

2、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。

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	净值增长率①	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
过去三个月	0.20%	0.02%	0.68%	0.04%	-0.48%	-0.02%
过去六个月	0.92%	0.02%	2.36%	0.04%	-1.44%	-0.02%
过去一年	1.35%	0.03%	3.31%	0.05%	-1.96%	-0.02%
过去三年	4.88%	0.04%	13.60%	0.05%	-8.72%	-0.01%
过去五年	10.65%	0.05%	24.05%	0.06%	-13.40%	-0.01%
自基金合 同生效起 至今	14.36%	0.07%	31.69%	0.06%	-17.33%	0.01%

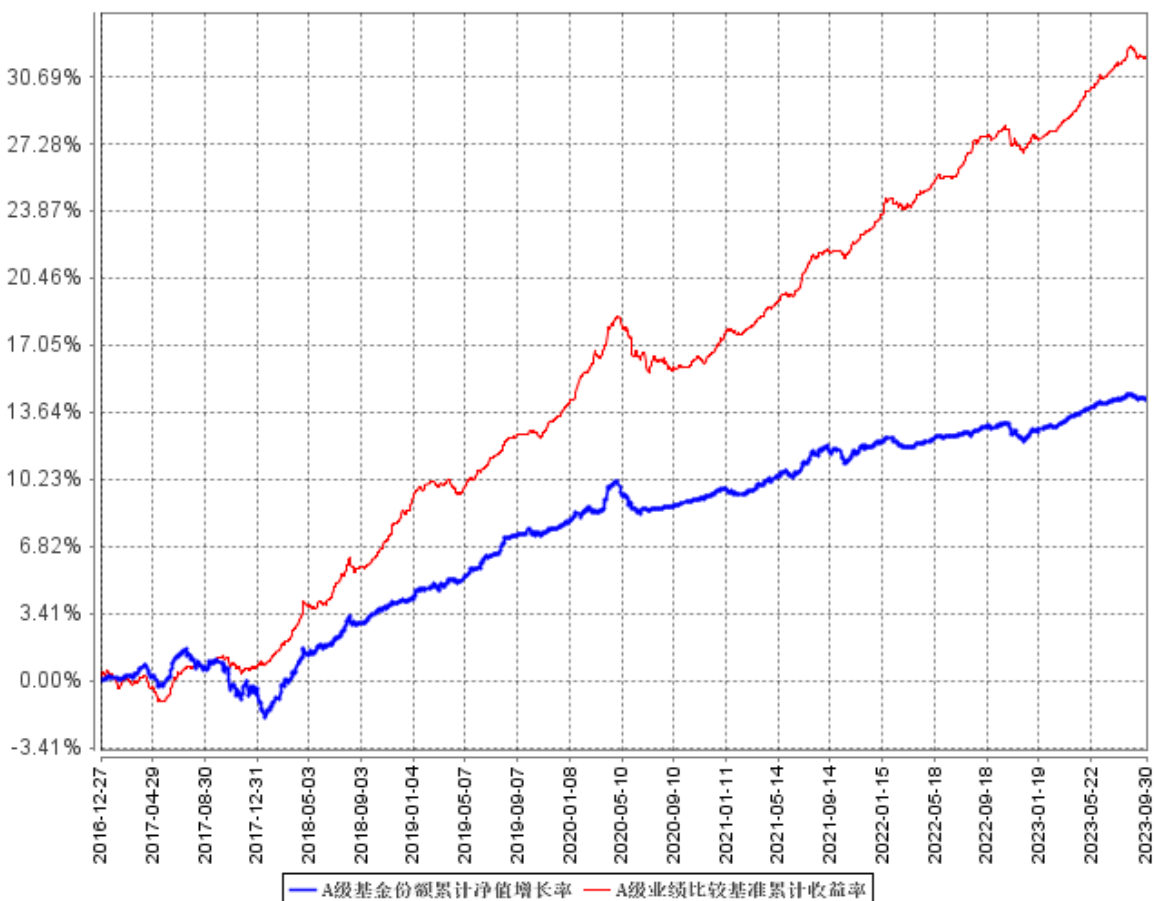
新沃通利纯债 C

阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基准收	①—③	②—④
----	------	-------	-------	---------	-----	-----

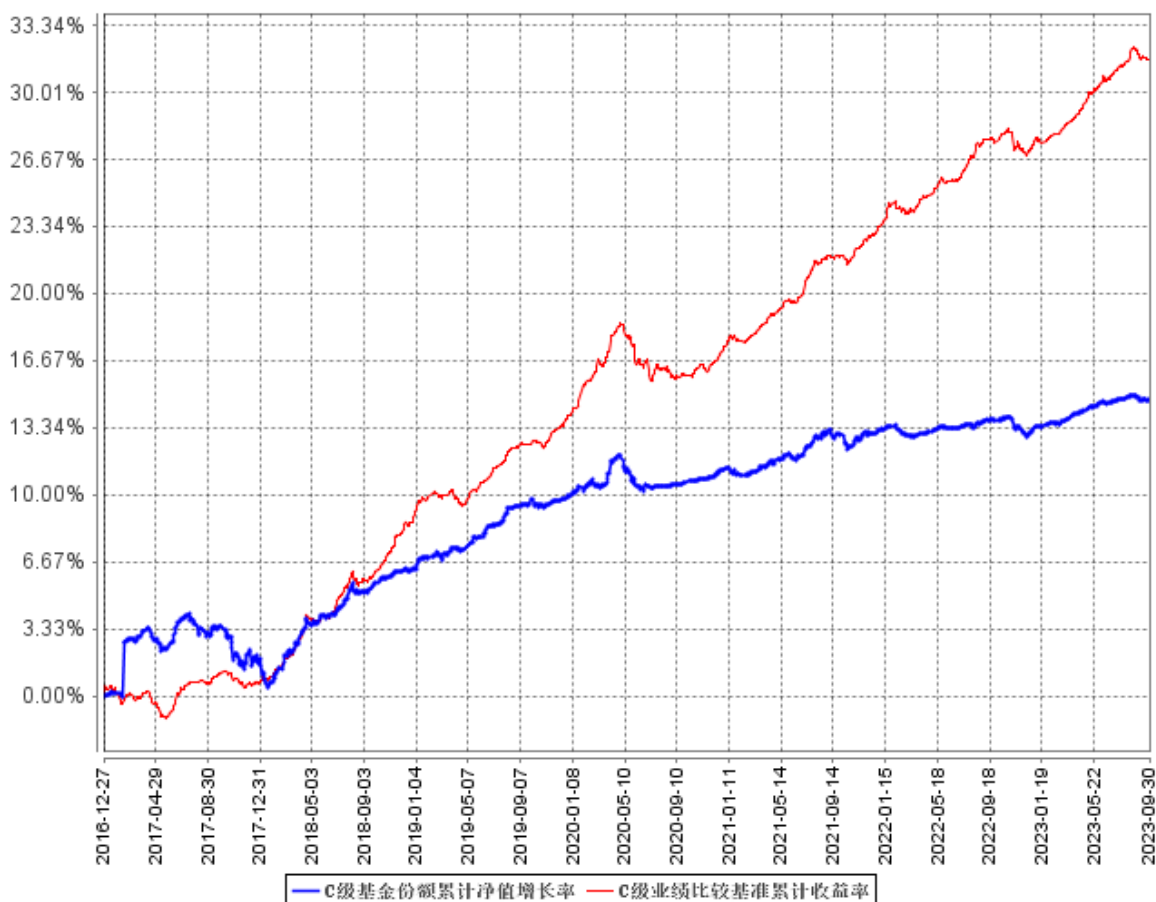
	率①	标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去三个月	0.11%	0.02%	0.68%	0.04%	-0.57%	-0.02%
过去六个月	0.72%	0.02%	2.36%	0.04%	-1.64%	-0.02%
过去一年	0.96%	0.03%	3.31%	0.05%	-2.35%	-0.02%
过去三年	3.70%	0.04%	13.60%	0.05%	-9.90%	-0.01%
过去五年	8.64%	0.05%	24.05%	0.06%	-15.41%	-0.01%
自基金合同生效起至今	14.74%	0.09%	31.69%	0.06%	-16.95%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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		
庄磊	本基金的基金经理	2022年10月26日	-	12年	中央财经大学金融学博士，中国籍。2001年7月起先后在北京银行股份有限公司资金交易部、资产管理部担任理财业务主管；贵阳银行股份有限公司理财投资部兼北京投行与同业中心担任副总经理；华泰汽车金融有限公司担任总裁助理；四川天府银行股份有限公司资产管理事业部担任副

					总裁；2020 年 9 月加入新沃基金管理有限公司，现担任固定收益部总经理兼基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《证券投资基金经营机构董事、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。

4.1.1 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

本报告期内，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 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非公平交易的情况。

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

经济基本面方面，三季度经济逐渐好转，但依然不稳定。三季度三个月制造业 PMI 指数分别为 49.3、49.7 和 50.2，逐月回升，9 月制造业 PMI 站上荣枯线。三季度非制造业 PMI 指数均在荣枯线以上，9 月非制造业 PMI 较 8 月有所回升。8 月社会消费品零售总额同比增速较 7 月加快，固定资产投资增速继续下滑，8 月规模以上工业增加值增速也较 7 月反弹。9 月进出口总额环比连续两月回升，同比降幅收窄，企稳回暖迹象明显。价格方面，8 月起 CPI 同比增速转正，环比增速

也转正。工业生产者价格指数 PPI 虽然 3 个月同比增速仍为负数，但降幅逐月收窄。金融数据方面，9 月社融新增数据明显强于预期。经济基本面缓慢复苏背景下，三季度债市呈先扬后抑的震荡态势。

货币市场方面，三季度资金面先松后紧。8 月央行下调 MLF 利率和 1 年期 LPR 利率，9 月下调存款准备金率，向市场释放流动性。虽然资金面有央行的大力呵护，但随着 8 月地方政府债发行的放量，且受税期扰动和季末长假因素的影响，资金面逐渐紧张。季末回购利率更是大幅飙升。

债券市场方面，三季度债市先扬后抑，收益率先下降后上升。7 月受较弱经济基本面影响，债市收益率整体下行。8 月受股市下行影响，收益率持续下行。10 年期国债收益率一度到 2.60%。9 月地产宽松政策陆续落地，经济基本面边际修复，资金面持续收敛，债市受到冲击。收益率大幅上行。10 年期国债收益率达到 2.70%附近。

信用债方面，三季度高等级信用债追随利率债走势，收益率先下后上。

三季度债券市场出现调整。随着经济复苏的逐渐确认，及年底地方政府债券的放量发行，债市有望延续三季度调整态势。本基金将适度降低组合平均久期，同时加大波段操作力度，增加短久期高等级信用债的投资，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。

4.5 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 1.0808 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.20%；截至本报告期末新沃通利纯债 C 基金份额净值为 1.0645 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.11%；同期业绩比较基准收益率为 0.68%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 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 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,887,949.75	94.96
	其中：债券	6,887,949.75	94.96
	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	209,771.62	2.89
	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	155,290.69	2.14
8	其他资产	309.38	0.00
9	合计	7,253,321.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,432,459.75	33.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,897,111.86	26.31

	其中：政策性金融债	717,267.57	9.95
4	企业债券	2,556,253.78	35.45
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	2,124.36	0.03
10	合计	6,887,949.75	95.51

注：其他为地方政府债。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	149345	21 长江 01	7,500	768,569.10	10.66
2	019678	22 国债 13	6,000	603,571.89	8.37
3	163321	20 能源 04	5,000	512,063.95	7.10
4	019693	22 国债 28	5,000	509,033.56	7.06
5	102220	国债 2220	5,000	499,436.16	6.93

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	309.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	309.38

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 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
报告期期初基金份额总额	7,945,151.97	84,004.88
报告期期间基金总申购份额	462.27	1,033.46
减：报告期期间基金总赎回份额	1,354,613.31	2,636.59
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	6,591,000.93	82,401.75

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	6,719,835.18
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	1,310,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,409,835.18
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	81.07

7.2 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	赎回	2023年9月28日	-560,000.00	-604,912.00	-
2	赎回	2023年8月31日	-250,000.00	-270,500.00	-
3	赎回	2023年7月31日	-500,000.00	-540,100.00	-
合计			-1,310,000.00	-1,415,512.00	

§ 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

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	20230701-20230930	6,719,835.18	-	1,310,000.00	5,409,835.18	81.07%
产品特有风险							

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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。

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

2023 年 10 月 24 日