

# 新沃通利纯债债券型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：二〇一八年八月二十九日

## § 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 27 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 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         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>11</b> |
| 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        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 15        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 16        |
| 6.2 利润表                                 | 17        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 18        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 19        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 40        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 40        |
| 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.....     | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 40        |
| 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.....    | 41        |
| 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..... | 41        |
| 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..... | 41        |
| 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.....    | 41        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 41        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                         | 42        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 43        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 43        |
| 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.....     | 43        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>44</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 45        |
| 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.....      | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 45        |
| 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.....         | 45        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 45        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 46        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>48</b> |
| 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.....    | 48        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 48        |

|                         |           |
|-------------------------|-----------|
| <b>§12 备查文件目录</b> ..... | <b>49</b> |
| 12.1 备查文件目录.....        | 49        |
| 12.2 存放地点.....          | 49        |
| 12.3 查阅方式.....          | 49        |

## § 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      | 30,368,321.68 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 | 21,238,477.68 份  | 9,129,844.00 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<br>负责人 | 姓名   | 陈阳                                    | 陆志俊                     |
|             | 联系电话 | 400-698-9988                          | 95559                   |
|             | 电子邮箱 | service@sinovofund.com                | luzj@bankcomm.com       |
| 客户服务电话      |      | 400-698-9988                          | 95559                   |
| 传真          |      | 010-58290555                          | 021-62701216            |
| 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 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址        |      | 北京市海淀区丹棱街 3 号中国电                      | 中国（上海）自由贸易试验区银城         |

|       |                |          |
|-------|----------------|----------|
|       | 子大厦 B 座 1616 室 | 中路 188 号 |
| 邮政编码  | 100080         | 200120   |
| 法定代表人 | 朱灿             | 彭纯       |

## 2.4 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  |

## 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 | 北京市海淀区丹棱街 3 号中国电子大厦 B 座 1616 室 |

### § 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(2018年1月1日 - 2018年6月30日) | 报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 53,146.89                   | 3,352.79                    |
| 本期利润          | 665,919.28                  | 13,421.30                   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0234                      | 0.0299                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.34%                       | 2.89%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.40%                       | 2.29%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日)            |                             |
| 期末可供分配利润      | -411,656.79                 | 17,481.18                   |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0194                     | 0.0019                      |
| 期末基金资产净值      | 21,654,080.11               | 9,511,986.20                |
| 期末基金份额净值      | 1.0196                      | 1.0419                      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2018年6月30日)            |                             |
| 基金份额累计净值增长率   | 1.96%                       | 4.19%                       |

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      | 0.16%    | 0.06%       | 0.62%      | 0.06%         | -0.46% | 0.00%  |
| 过去三个月      | 1.56%    | 0.09%       | 1.95%      | 0.10%         | -0.39% | -0.01% |
| 过去六个月      | 2.40%    | 0.11%       | 3.87%      | 0.08%         | -1.47% | 0.03%  |
| 过去一年       | 0.65%    | 0.13%       | 4.25%      | 0.07%         | -3.60% | 0.06%  |
| 自基金合同生效起至今 | 1.96%    | 0.11%       | 4.61%      | 0.07%         | -2.65% | 0.04%  |

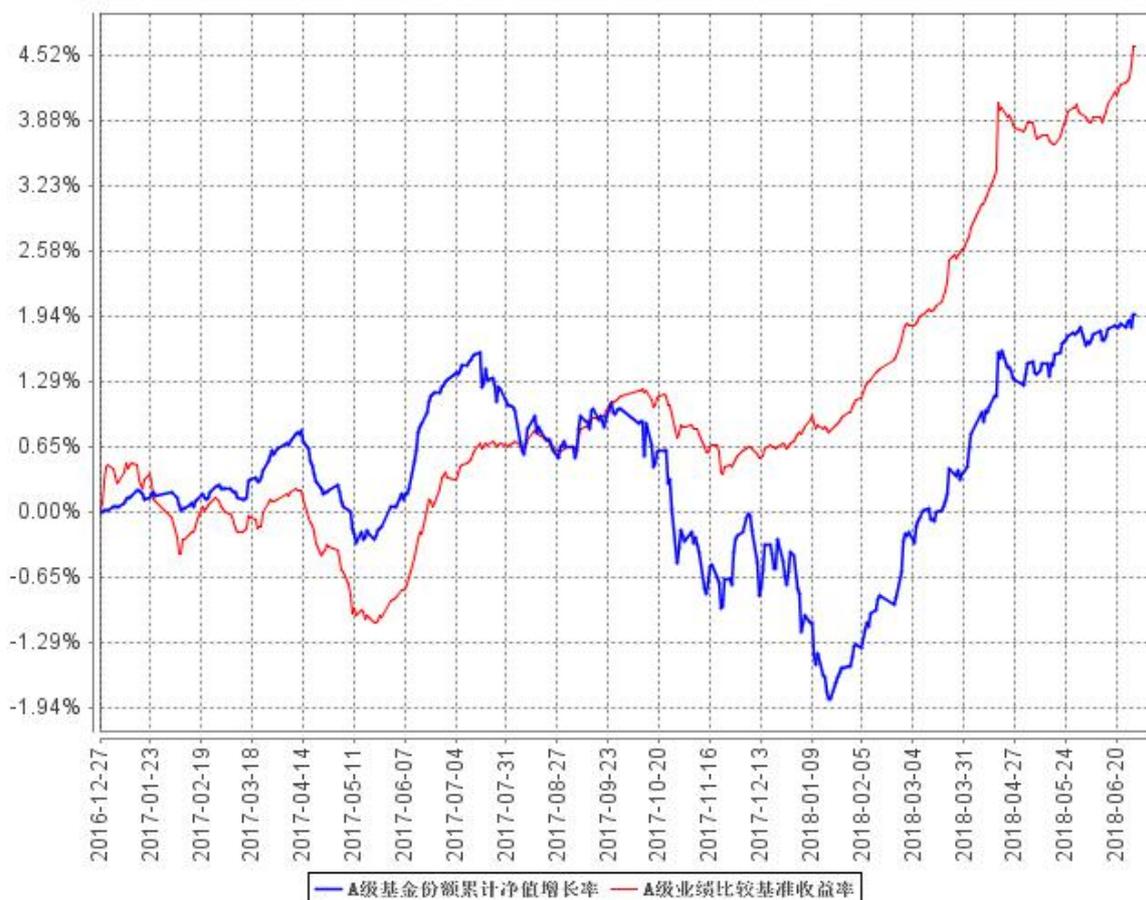
新沃通利纯债 C

| 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      | 0.14%    | 0.06%       | 0.62%      | 0.06%         | -0.48% | 0.00%  |
| 过去三个月      | 1.54%    | 0.09%       | 1.95%      | 0.10%         | -0.41% | -0.01% |
| 过去六个月      | 2.29%    | 0.11%       | 3.87%      | 0.08%         | -1.58% | 0.03%  |
| 过去一年       | 0.37%    | 0.13%       | 4.25%      | 0.07%         | -3.88% | 0.06%  |
| 自基金合同生效起至今 | 4.19%    | 0.18%       | 4.61%      | 0.07%         | -0.42% | 0.11%  |

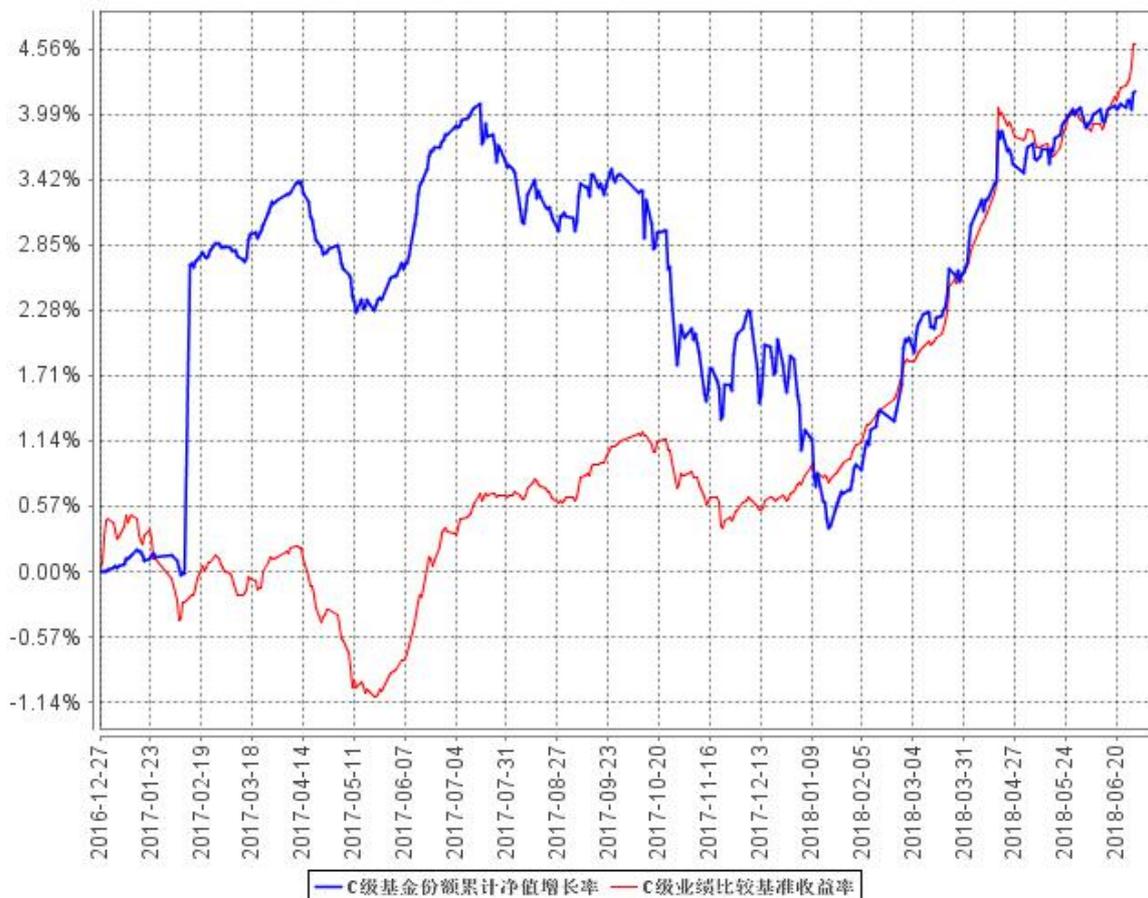
注：本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则，本基金选取“中债综合指数收益率”作为本基金的比较基准。

### 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



## § 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<br>(助理) 期限 |                   | 证券从<br>业年限 | 说明  |
|----|--------------|----------------------|-------------------|------------|---|
|    |              | 任职日期                 | 离任日期              |            |   |
| 俞臻 | 本基金的<br>基金经理 | 2018 年<br>3 月 8 日    | -                 | 5 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。   |
| 武亮 | -            | 2016 年<br>12 月 29 日  | 2018 年<br>3 月 8 日 | 7 年        | 香港城市大学博士，中国籍。2011 年 8 月至 2012 年 9 月任职于海通证券，担任研究所固定收益研究员；2012 年 10 月至 2016 年 10 月任职于平安资产管理有限责任公司，历任债券研究部策略主管、固收资管部投资经理等职务；2016 年 10 月加入新沃基金管理有限公司，任固定收益部总经理。 |

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，本基金运作符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

### 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

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。

#### 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

2018 年一季度，经济保持平稳，略有下行压力；二季度，经济下行压力增大。市场流动性方面，资金面宽松，R007 处于近 6 个月以来低位。3 月 22 日央行在美联储正式加息后随即跟随加息，上调 7 天逆回购操作利率 5BP 至 2.55%。超小幅上调利率使得市场情绪整体良好，3 月股份制同业存单利率由 4.8% 降至 4.25% 附近。6 月上旬，央行在扩大担保品范围的基础上超额续作到期 MLF，6 月 24 日央行定向降准 0.5 个百分点，释放资金约 7000 亿元，释放了充裕流动性。同期，央行货币政策委员会二季度会议上将流动性定调由“合理稳定”进一步改变至“合理充裕”，货币流动性可能将面临进一步宽松。同业存单市场上，国有商业银行发行放量，收益率大幅度下降。截止 6 月份，作为标杆的 3 个月股份制同业存单利率由 4.5% 降至 3.8%。七天回购定盘利率 FR007 为 3.87%，相对于前期的季末资金利率水平有大幅度下降，流动性整体宽裕。

国际环境方面，中美之间的贸易战导致世界两大经济体之间业已紧张的贸易关系进一步升级。国际环境方面，中美之间的贸易战叠加中美货币政策的分化，人民币在 6 月下旬快速贬值。债券市场方面，利率债 10 年期国债利率从 4 月的 3.74% 降至 3.48%，10 年期国开债利率从 4.65% 降至 4.25%，债市呈现一波牛市行情。

报告期内，本基金采取长短久期相结合的策略提高组合凸性防范利率风险，以短期和长期利率债为主，同时配置少量短期高等级的优质公司债，杠杆率控制在合适的水平，在维持一定流动

性的前提下争取获得更高收益。

#### 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 1.0196 元,本报告期基金份额净值增长率为 2.40%;截至本报告期末新沃通利纯债 C 基金份额净值为 1.0419 元,本报告期基金份额净值增长率为 2.29%;同期业绩比较基准收益率为 3.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年下半年,国内经济稳中趋缓,基本面总体对短端债券品种构成支撑。在宽货币宽信用政策环境下,资金面将保持持续宽松,同时信用利差将有不同程度的缩减。目前政策方面有对经济的刺激预期,长端债券可能面临一定的调整,同时在中美经济基本面的差异和贸易战持续发酵的背景下,人民币的贬值压力可能加大,对债市需求构成一定冲击。债市在经历收益率持续下行后可能面临一定回调风险,通利将及时调整账户结构,防范利率风险以及流动性冲击。

#### 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，本基金于 2018 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 7 日期间出现连续 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 2018 年 1 月 2 日至 2018 年 6 月 29 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

2018 年上半年度，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

2018 年上半年度，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、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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

2018 年上半年度，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半年度报告中财务指标、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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 2,988,551.06                   | 151,484.63                       |
| 结算备付金           |            | 262,164.96                     | 353,662.64                       |
| 存出保证金           |            | 2,988.28                       | 2,118.31                         |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 27,553,047.60                  | 40,289,257.50                    |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 27,553,047.60                  | 40,289,257.50                    |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 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    | 2,000,000.00                   | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 465,561.01                     | 679,513.65                       |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 1,304,101.54                   | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 34,576,414.45                  | 41,476,036.73                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 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       |            | -                              | 9,499,865.75                     |
| 应付证券清算款         |            | 2,978,334.70                   | -                                |
| 应付赎回款           |            | 363,322.19                     | 196.49                           |
| 应付管理人报酬         |            | 10,981.88                      | 13,523.49                        |
| 应付托管费           |            | 3,294.55                       | 4,057.04                         |
| 应付销售服务费         |            | 462.86                         | 82.95                            |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | -                              | 3,078.49                         |
| 应交税费            |            | 60.18                          | -                                |

|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利息          |          | -             | 7,904.10      |
| 应付利润          |          | -             | -             |
| 递延所得税负债       |          | -             | -             |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 53,891.78     | 145,000.15    |
| 负债合计          |          | 3,410,348.14  | 9,673,708.46  |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 30,368,321.68 | 31,933,809.16 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 797,744.63    | -131,480.89   |
| 所有者权益合计       |          | 31,166,066.31 | 31,802,328.27 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 34,576,414.45 | 41,476,036.73 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 30,368,321.68 份，其中 A 类基金份额净值 1.0196 元，基金份额总额 21,238,477.68 份；C 类基金份额净值 1.0419 元，基金份额总额 9,129,844.00 份。

## 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 867,264.89                               | 3,616,883.62                                  |
| 1.利息收入                |            | 558,797.65                               | 8,803,405.84                                  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 3,091.19                                 | 1,631,426.23                                  |
| 债券利息收入                |            | 553,219.97                               | 5,495,544.64                                  |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 2,486.49                                 | 1,676,434.97                                  |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -317,162.97                              | -4,883,586.45                                 |
| 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   | -317,162.97                              | -5,527,736.45                                 |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.5 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -  | 644,150.00                                    |
| 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   | 622,840.90                               | -447,782.95                                   |
| 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   | 2,789.31   | 144,847.18   |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 187,924.31 | 2,351,343.87 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 71,893.84  | 907,264.92   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 21,568.17  | 272,179.51   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 763.52     | 101,291.69   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 943.09     | 16,991.07    |
| 5. 利息支出                    |            | 29,374.34  | 967,802.86   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 29,374.34  | 967,802.86   |
| 6. 税金及附加                   |            | 20.37      | -            |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 63,360.98  | 85,813.82    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 679,340.58 | 1,265,539.75 |
| 减：所得税费用                    |            | -          | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 679,340.58 | 1,265,539.75 |

### 6.3 所有者权益（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：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>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）                   | 31,933,809.16              | -131,480.89 | 31,802,328.27  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                          | 679,340.58  | 679,340.58     |
| 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） | -1,565,487.48              | 249,884.94  | -1,315,602.54  |
| 其中：1.基金申购款                        | 10,733,711.22              | 420,648.87  | 11,154,360.09  |
| 2.基金赎回款                           | -12,299,198.70             | -170,763.93 | -12,469,962.63 |
| 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)                    |                                 |              |                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 30,368,321.68                   | 797,744.63   | 31,166,066.31   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017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)                        | 613,909,342.32                  | 144,519.17   | 614,053,861.49  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | 1,265,539.75 | 1,265,539.75    |
| 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)      | -516,088,378.27                 | -108,480.53  | -516,196,858.80 |
| 其中：1.基金申购款                             | 60,643,373.85                   | 272,404.17   | 60,915,778.02   |
| 2.基金赎回款                                | -576,731,752.12                 | -380,884.70  | -577,112,636.82 |
| 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) | -                               | -            | -               |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 97,820,964.05                   | 1,301,578.39 | 99,122,542.44   |

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：

\_\_\_\_\_ 库三七                      \_\_\_\_\_ 库三七                      \_\_\_\_\_ 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[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，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

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》和《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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、可分离交易可转换的纯债部分、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。

#### 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》、《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同》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 2018 年 01 月 01 日至 2018 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 2018 年 06 月 30 日的财务状况以及 2018 年 01 月 01 日至 2018 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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、[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。

(5) 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<br>2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,988,551.06           |
| 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：            | 2,988,551.06           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |               |            |
|-------------------|------------------------|---------------|------------|
|                   | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动     |
| 股票                | -                      | -             | -          |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -             | -          |
| 债券                | 交易所市场                  | 17,271,470.27 | 348,577.33 |
|                   | 银行间市场                  | 9,857,160.00  | 75,840.00  |

|        |    |               |               |            |
|--------|----|---------------|---------------|------------|
|        | 合计 | 27,128,630.27 | 27,553,047.60 | 424,417.33 |
| 资产支持证券 |    | -             | -             | -          |
| 基金     |    | -             | -             | -          |
| 其他     |    | -             | -             | -          |
| 合计     |    | 27,128,630.27 | 27,553,047.60 | 424,417.33 |

### 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<br>2018年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 2,000,000.00      | -         |
| 银行间市场 | -                 | -         |
| 合计    | 2,000,000.00      | -         |

#### 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从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<br>2018年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 436.42            |
| 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  | 118.00            |
| 应收债券利息     | 465,588.03        |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | -582.74           |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 1.30              |
| 合计         | 465,561.01        |

**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**

本基金本报告期末无应付交易费用。

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 260.80            |
| 预提费用        | 53,630.98         |
| 合计          | 53,891.78         |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 新沃通利纯债 A      |                            |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
| 项目            | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                |
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 31,719,815.77              | 31,719,815.77  |
| 本期申购          | 449,214.75                 | 449,214.75     |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -10,930,552.84             | -10,930,552.84 |
| - 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           | 21,238,477.68              | 21,238,477.68  |

金额单位：人民币元

| 新沃通利纯债 C      |                            |               |
|---------------|----------------------------|---------------|
| 项目            | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |               |
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额          |
| 上年度末          | 213,993.39                 | 213,993.39    |
| 本期申购          | 10,284,496.47              | 10,284,496.47 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,368,645.86              | -1,368,645.86 |

|               |              |              |
|---------------|--------------|--------------|
| - 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           | 9,129,844.00 | 9,129,844.00 |

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

| 新沃通利纯债 A       |             |             |             |
|----------------|-------------|-------------|-------------|
| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分       | 未分配利润合计     |
| 上年度末           | -722,973.74 | 587,517.28  | -135,456.46 |
| 本期利润           | 53,146.89   | 612,772.39  | 665,919.28  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 258,170.06  | -373,030.45 | -114,860.39 |
| 其中：基金申购款       | -9,766.71   | 16,152.86   | 6,386.15    |
| 基金赎回款          | 267,936.77  | -389,183.31 | -121,246.54 |
| 本期已分配利润        | -           | -           | -           |
| 本期末            | -411,656.79 | 827,259.22  | 415,602.43  |

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    |
| 上年度末           | -102.50   | 4,078.07   | 3,975.57   |
| 本期利润           | 3,352.79  | 10,068.51  | 13,421.30  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 14,230.89 | 350,514.44 | 364,745.33 |
| 其中：基金申购款       | 13,573.24 | 400,689.48 | 414,262.72 |
| 基金赎回款          | 657.65    | -50,175.04 | -49,517.39 |
| 本期已分配利润        | -         | -          | -          |
| 本期末            | 17,481.18 | 364,661.02 | 382,142.20 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期                   |
|----------|----------------------|
|          | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 2,433.44             |
| 定期存款利息收入 | -                    |
| 其他存款利息收入 | -                    |

|           |          |
|-----------|----------|
| 结算备付金利息收入 | 633.28   |
| 其他        | 24.47    |
| 合计        | 3,091.19 |

#### 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<br>2018年1月1日至2018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 | -317,162.97                |
| 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                            | -317,162.97                |

##### 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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 47,729,723.15              |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 47,147,233.62              |
| 减：应收利息总额                | 899,652.50                 |
| 买卖债券差价收入                | -317,162.97                |

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**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**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 622,840.90                 |
| ——股票投资                     | -                          |
| ——债券投资                     | 622,840.90                 |
| ——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<br>增值税 | -                          |
| 合计                         | 622,840.90                 |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 2,789.31                   |
| 合计      | 2,789.31                   |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额 25% 的部分计入基金资产。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 243.09                                |
| 银行间市场交易费用 | 700.00                                |
| 合计        | 943.09                                |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 24,795.19                             |
| 信息披露费 | 19,835.79                             |
| 其他    | 600.00                                |
| 帐户维护费 | 18,000.00                             |
| 银行费用  | 130.00                                |
| 合计    | 63,360.98                             |

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

| 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 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”） | 基金托管人、基金代销机构        |
| 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。

#### 6.4.10 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

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的交易。

## 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                         |
|-----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                 | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 71,893.84                       | 907,264.92                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,393.61                        | 24,737.23                       |

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 0.50% 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 X 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                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 21,568.17                       | 272,179.51                      |

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 0.15% 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 X 0.15% / 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                              |          |        |
|----------------|---------------------------------|----------|--------|
|                | 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                |          |        |
|                | 新沃通利纯债 A                        | 新沃通利纯债 C | 合计     |
| 新沃基金           | -                               | 41.88    | 41.88  |
| 交通银行股份有限公司     | -                               | 106.67   | 106.67 |
| 合计             | -                               | 148.55   | 148.55 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |          |        |
|                | 2017 年 1 月 1 日至 2017 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    |
|------------|----------|----------|-------|
| 交通银行股份有限公司 | -        | 92.99    | 92.99 |
| 合计         | -        | 92.99    | 92.99 |

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

单位：人民币元

| 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日      |               |      |       |      |       |      |
|--|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易<br>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 |
| 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |               |      |       |      |       |      |
| 银行间市场交易<br>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 |
| 交通银行                                       | 19,563,138.36 | -    | -     | -    | -     | -    |

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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 | -                                     | -        |
| 期初持有的基金份额                        | 19,808,835.18                         | -        |
| 期间申购/买入总份额                       | -                                     | -        |
| 期间因拆分变动份额                        | -                                     | -        |
| 减：期间赎回/卖出总份额                     | -                                     | -        |
| 期末持有的基金份额                        | 19,808,835.18                         | -        |

|                       |        |   |
|-----------------------|--------|---|
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 93.27% | - |
|-----------------------|--------|---|

| 项目                               | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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 | -  | -        |
| 期初持有的基金份额                        | -  | -        |
| 期间申购/买入总份额                       | -  | -        |
| 期间因拆分变动份额                        | -  | -        |
| 减：期间赎回/卖出总份额                     | -  | -        |
| 期末持有的基金份额                        | -  | -        |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例            | -  | -        |

#### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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 | 2,988,551.06                          | 2,433.44 | 33,877.29                                  | 55,791.27 |

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金报告期内无利润分配。

## 6.4.12 期末（2018 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

本基金报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 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

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 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

其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。

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。

##### 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<br>2018年6月30日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 10,832,847.20     | -                   |
| 合计     | 10,832,847.20     | -                   |

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 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<br>2018年6月30日 | 上年度末<br>2017年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
|--------|-------------------|---------------------|

|        |               |   |
|--------|---------------|---|
| AAA    | 4,719,084.60  | - |
| AAA 以下 | -             | - |
| 未评级    | 12,001,115.80 | - |
| 合计     | 16,720,200.40 | - |

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金所持证券均在银行间同业市场交易，均能以合理价格适时变现。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。

##### 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制），本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

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，报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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<br>2018 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                     | 2,988,551.06  | -            | -             | -             | 2,988,551.06  |
| 结算备付金                    | 262,164.96    | -            | -             | -             | 262,164.96    |
| 存出保证金                    | 2,988.28      | -            | -             | -             | 2,988.28      |
| 交易性金融资产                  | 15,547,922.30 | 8,282,209.50 | 3,722,915.80  | -             | 27,553,047.60 |
| 买入返售金融资产                 | 2,000,000.00  | -            | -             | -             | 2,000,000.00  |
| 应收利息                     | -             | -            | -             | 465,561.01    | 465,561.01    |
| 应收申购款                    | -             | -            | -             | 1,304,101.54  | 1,304,101.54  |
| 资产总计                     | 20,801,626.60 | 8,282,209.50 | 3,722,915.80  | 1,769,662.55  | 34,576,414.45 |
| 负债                       |               |              |               |               |               |
| 应付证券清算款                  | -             | -            | -             | 2,978,334.70  | 2,978,334.70  |
| 应付赎回款                    | -             | -            | -             | 363,322.19    | 363,322.19    |
| 应付管理人报酬                  | -             | -            | -             | 10,981.88     | 10,981.88     |
| 应付托管费                    | -             | -            | -             | 3,294.55      | 3,294.55      |
| 应付销售服务费                  | -             | -            | -             | 462.86        | 462.86        |
| 应交税费                     | -             | -            | -             | 60.18         | 60.18         |
| 其他负债                     | -             | -            | -             | 53,891.78     | 53,891.78     |
| 负债总计                     | -             | -            | -             | 3,410,348.14  | 3,410,348.14  |
| 利率敏感度缺口                  | 20,801,626.60 | 8,282,209.50 | 3,722,915.80  | -1,640,685.59 | 31,166,066.31 |
| 上年度末<br>2017 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                     | 151,484.63    | -            | -             | -             | 151,484.63    |
| 结算备付金                    | 353,662.64    | -            | -             | -             | 353,662.64    |
| 存出保证金                    | 2,118.31      | -            | -             | -             | 2,118.31      |
| 交易性金融资产                  | 1,912,127.50  | 9,621,580.00 | 28,755,550.00 | -             | 40,289,257.50 |
| 应收利息                     | -             | -            | -             | 679,513.65    | 679,513.65    |
| 资产总计                     | 2,419,393.08  | 9,621,580.00 | 28,755,550.00 | 679,513.65    | 41,476,036.73 |
| 负债                       |               |              |               |               |               |
| 卖出回购金融资产款                | 9,499,865.75  | -            | -             | -             | 9,499,865.75  |
| 应付赎回款                    | -             | -            | -             | 196.49        | 196.49        |
| 应付管理人报酬                  | -             | -            | -             | 13,523.49     | 13,523.49     |
| 应付托管费                    | -             | -            | -             | 4,057.04      | 4,057.04      |
| 应付销售服务费                  | -             | -            | -             | 82.95         | 82.95         |
| 应付交易费用                   | -             | -            | -             | 3,078.49      | 3,078.49      |
| 应付利息                     | -             | -            | -             | 7,904.10      | 7,904.10      |
| 其他负债                     | -             | -            | -             | 145,000.15    | 145,000.15    |
| 负债总计                     | 9,499,865.75  | -            | -             | 173,842.71    | 9,673,708.46  |
| 利率敏感度缺口                  | -7,080,472.67 | 9,621,580.00 | 28,755,550.00 | 505,670.94    | 31,802,328.27 |

**6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

| 假设          | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                   |
|-------------|--------------------|---------------------------------|-------------------|
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                   |
|             |                    | 本期末（2018年6月30日）                 | 上年度末（2017年12月31日） |
|             | 市场利率下降25个基点        | 229,644.86                      | 626,931.73        |
| 市场利率上升25个基点 | 220,634.47         | 613,027.37                      |                   |

**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，因此无重大外汇风险。

**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。

**6.4.14 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 2018 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工具中属于第二层次的余额为 27,553,047.60 元，无第一和第三层次。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本年变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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)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，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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定

资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

(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。

## § 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  | 固定收益投资            | 27,553,047.60 | 79.69         |
|    | 其中：债券             | 27,553,047.60 | 79.69         |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | 2,000,000.00  | 5.78          |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 3,250,716.02  | 9.40          |
| 7  | 其他各项资产            | 1,772,650.83  | 5.13          |
| 8  | 合计                | 34,576,414.45 | 100.00        |

### 7.2 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      | 12,001,115.80 | 38.51         |
| 2  | 央行票据      | -             | -             |
| 3  | 金融债券      | 9,933,000.00  | 31.87         |
|    | 其中：政策性金融债 | 9,933,000.00  | 31.87         |
| 4  | 企业债券      | 5,618,931.80  | 18.03         |
| 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        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 27,553,047.60 | 88.41 |

## 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  | 160208 | 16 国开 08 | 100,000 | 9,933,000.00 | 31.87        |
| 2  | 010107 | 21 国债(7) | 81,000  | 8,278,200.00 | 26.56        |
| 3  | 019517 | 15 国债 17 | 37,420  | 3,722,915.80 | 11.95        |
| 4  | 122465 | 15 广越 01 | 25,000  | 2,493,750.00 | 8.00         |
| 5  | 112190 | 11 亚迪 02 | 22,150  | 2,220,316.00 | 7.12         |

## 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

本基金本报告期内未持有国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1** 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。

**7.11.2** 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   | 2,988.28     |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 465,561.01   |
| 5  | 应收申购款   | 1,304,101.54 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,772,650.83 |

### 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 | 203      | 104,623.04 | 19,810,814.23 | 93.28% | 1,427,663.45  | 6.72%   |
| 新沃通利纯债 C | 514      | 17,762.34  | 0.00          | -      | 9,129,844.00  | 100.00% |
| 合计       | 717      | 42,354.70  | 19,810,814.23 | 65.24% | 10,557,507.45 | 34.76%  |

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 | 2,278.13  | 0.0107%  |
|                  | 新沃通利纯债 C | 2,724.67  | 0.0298%  |
|                  | 合计       | 5,002.80  | 0.0165%  |

### 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、基金投资和研究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 | 0~10              |
|                                | 新沃通利纯债 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0~10              |

## § 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                    | 31,719,815.77  | 213,993.39     |
| 本报告期基金总申购份额                     | 449,214.75     | 10,284,496.47  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 10,930,552.84  | 1,368,645.86   |
| 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                     | 21,238,477.68  | 9,129,844.00   |

## § 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 |    |
| 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，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 | 40,469,993.47 | 100.00%      | 97,300,000.00 | 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  | 新沃基金管理有限公司关于增加金惠家保险代理有限公司为基金销售机构的公告  | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年1月10日 |
| 2  | 新沃通利纯债债券型证券投资基金2017年第4季度报告           | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年1月19日 |
| 3  | 新沃通利纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)(2018年第1号)   | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年2月7日  |
| 4  | 新沃通利纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2018年第1号) | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年2月7日  |
| 5  | 关于新沃通利纯债债券型证券投资基金基金经理变更的公告           | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年3月9日  |
| 6  | 新沃通利纯债债券型证券投资基金托管协议                  | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年3月22日 |

|    |   |              |            |
|----|---|--------------|------------|
| 7  | 新沃基金管理有限公司关于修订旗下基金基金合同、托管协议及招募说明书等法律文件的公告         | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年3月22日 |
| 8  | 新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同                               | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年3月22日 |
| 9  | 新沃通利纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)(2018年第2号)                | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年3月22日 |
| 10 | 新沃通利纯债债券型证券投资基金2017年年度报告                          | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年3月30日 |
| 11 | 新沃通利纯债债券型证券投资基金2017年年度报告摘要                        | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年3月30日 |
| 12 | 新沃基金管理有限公司关于新沃通利纯债债券型证券投资基金增加恒天明泽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 | 2018年4月2日  |
| 13 | 新沃基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为基金销售机构的公告            | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年4月2日  |
| 14 | 新沃基金管理有限公司关于增加上海有鱼基金销售有限公司为基金销售机构的公告              | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年4月20日 |
| 15 | 新沃通利纯债债券型证券投资基金2018年第1季度报告                        | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年4月23日 |
| 16 | 新沃基金管理有限公司关于直销网上交易系统开通银联支付业务的公告                   | 指定报刊和/或管理人网站 | 2018年5月24日 |
| 17 | 新沃基金管理有限公司关于北京懒猫金融信息服务有限公司终止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 | 2018年6月1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              | 2018/01/01-2018/06/30   | 19,808,835.18 | 0.00 | 0.00 | 19,808,835.18 | 65.23% |
| 产品特有风险  |                |                         |               |      |      |               |        |
| <p>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。</p> |                |                         |               |      |      |               |        |

### 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《新沃通利纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新沃通利纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会规定的其他备查文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的办公场所。

### 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

2018年8月29日