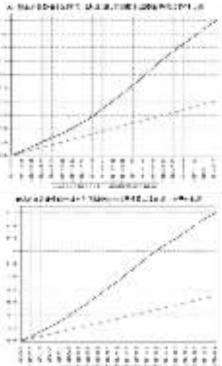


新沃通宝货币市场基金

2019年第一季度报告

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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。

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 管理人对于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》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，为基金份额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》等法律法规制定了《公平交易管理办法》。《公平交易管理办法》,对管理人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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度，基本面在政策影响下，部分数据开始走强，而流动性依然宽松。从货币市场具体来看，R007长期低位，仅在季末时点有波动抬升。同业存单市场上，股份制银行发行收益率总体平稳，作为标杆的3个月股份制同业存单利率最高点仅为2.85%，季末效应明显弱化，而机构申购依旧踊跃。

国际环境方面，中美之间的贸易战有所缓和，未来汇率可能保持相对强势。

债券市场方面，长端走势与短端分化明显，利率债10年期国债开债活跃从3.58%上行至3.70%，机构对于未来基本走势出现分歧，利率债波动加大。本基金报告期内保持了相对较高久期，同时针对监管要求，在季节性时点增强流动性，不间断进行负债端流动性审查和匹配，持续跟踪持仓信用安全，定期进行压力测试，保证了账户的平稳运行。

4.5 报告期内基金的投资表现

本报告期新沃通宝A的基金份额净值收益率为3.06979%，本报告期新沃通宝B的基金份额净值收益率为0.7577%，同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二千人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

1	固定收益资产	2,718,729,179.13	67.03
	其中：债券	2,664,520,542.41	66.76
	资产支持证券	51,208,636.72	1.26
2	买入返售金融资产	948,062,704.96	23.32
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	--	--
3	银行存款和结算备付金合计	106,506,547.97	4.55
4	其他资产	206,439,496.31	5.10
5	合计	4,081,727,927.51	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

1	报告期内债券回购融资余额	4.31	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	149,999,685.00	3.85
	其中：买断式回购融资	—	—

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均久期期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限根本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	94
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	—
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

报告期末投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过120天的情

6.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	报告期末投资组合平均剩余期限分布比例（%）	报告期末投资组合平均剩余期限分布比例（%）
1	30天以内	23.67	3.86
2	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债	6.64	—
3	30天以上-60天	—	—
4	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债	—	—
5	60天以上-90天	23.28	—
6	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债	—	—
7	90天以上-120天	13.04	—
8	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债	—	—
9	120天以上-397天（含）	22.07	—
10	其中：剩余存续期限超过397天的浮动利率债	—	—
合计	94.01	3.86	—

5.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过240天的情形。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	期末成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国债	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债	220,140,240.75	5.45
4	其中：政策性金融债	220,140,240.75	5.45
5	企业债	—	—
6	企业短期融资券	661,052,728.18	16.17
7	中期票据	50,740,262.58	1.26
8	资产支持证券	1,802,071,267.88	44.23
9	其他	—	—
10	合计	2,664,520,542.41	66.76

注：1.表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 报告期末按摊余成本法估值债券资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111919344	18国债非国2354	1,500,000	148,000,788.75
2	01190222	18国债非国2354	1,500,000	150,448,322.48
3	111919344	18国债非国2354	1,500,000	150,742,781.34
4	1800097	18国债非国2354	1,000,000	100,607,919.38
5	111919344	18国债非国2354	1,000,000	99,460,523.19
6	111919344	18国债非国2354	1,000,000	99,065,166.64
7	111919344	18国债非国2354	1,000,000	98,406,701.68
8	111919344	18国债非国2354	1,000,000	97,788,572.24
9	111919344	18国债非国2354	1,000,000	97,788,572.24
10	111919344	18国债非国2354	1,000,000	97,788,572.24

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期末偏离度的绝对值在0%-0.5%的情况	0
报告期末偏离度的最高值	0.377%
报告期末偏离度的最低值	-0.0626%
报告期末偏离度绝对值在0%-0.5%的情况	0.0626%

报告期末偏离度的绝对值在0%-0.5%的情况说明

本基金报告期内无偏离度绝对值达到0.25%的情况说明

本基金报告期内无偏离度绝对值达到0.25%的情况说明

报告期末偏离度的绝对值在0%-0.5%的情况说明

本基金本报告期末无偏离度绝对值达到0.5%的情况说明

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

序号	资产名称	期末成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111919344	1,500,000	148,000,788.75
2	01190222	1,500,000	150,448,322.48
3	111919344	1,500,000	150,742,781.34
4	1800097	1,000,000	100,607,919.38
5	111919344	1,000,000	99,460,523.19
6	111919344	1,000,000	99,065,166.64
7	111919344	1,000,000	98,406,701.68
8	111919344	1,000,000	97,788,572.24
9	111919344	1,000,000	97,788,572.24
10	111919344	1,000,000	97,788,572.24

5.9 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	期末成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300184	双成药业	3,569,001	32,365,262.88
2	002223	瀚川股份	3,727,731	33,947,393.43
3	600972	中伟高新	1,607,632	14,698,735.62
4	000583	海康达	5,088,946	46,545,461.36
5	601617	明德医药	987,100	9,044,760.16
6	300628	亿联网络	496,240	45,200,750.01
7	002512	中泰化学	496,240	45,200,750.01
8	002127	南极电商	4,024,023	36,789,466.47
9	002044	贵州燃气	2,431,491	22,311,477.69
10	000003	中兴通讯	1,546,007	14,184,864.40

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	期末成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国债	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债	—	—
4	企业债	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	资产支持证券	2,476,000.00	0.20
8	其他	—	—
9	合计	2,476,000.00	0.20

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	期末成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111920	国债非国2354	24,760	2,476,000.00
2	—	—	—	—
3	—	—	—	—
4	—	—	—	—
5	—	—	—	—

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

序号	资产名称	期末成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	—	—	—
2	—	—	—
3	—	—	—
4	—	—	—
5	—	—	—

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

序号	贵金属名称	期末成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	—	—	—
2	—	—	—
3	—	—	—
4	—	—	—
5	—	—	—

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

序号	权证名称	期末成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	—	—	—
2	—	—	—
3	—	—	—
4	—	—	—
5	—	—	—

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金股指期货投资的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特

殊情况下流动性风险，如大额申购赎回时，大量分红等。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.1 本期国债期货投资政策

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 本期国债期货投资政策

5.10.4 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.5 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.6 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.7 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.8 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.13 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.14 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.15 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.16 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.17 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.18 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.19 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.20 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.21 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.22 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.23 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.24 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.25 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.26 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.27 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.28 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.29 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.30 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.31 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.32 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.33 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.34 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.35 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.36 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.37 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.38 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.39 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.40 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.41 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.42 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.43 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.44 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.45 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.46 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.47 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.48 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.49 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.50 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.51 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.52 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.53 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.54 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.55 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.56 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.57 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.58 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.59 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细