新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华外延增长主题灵活配置混合
基金主代码	003238
交易代码	003238
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月2日
报告期末基金份额总额	285,744,883.63份
投资目标	重点关注国家产业升级发展过程中带来的投资机会,综合运用多种投资策略,精选外延增长主题的优质企业进行投资,在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,力争为投资人提供长期超定的回报。
投资策略	投资策略方面,本基金将以大类资产配置策略为基础,采取积极的股票投资策略和稳健的债券投资策略。大类资产配置策略主要运用战略性资产配置策略和战术性资产配置策略。股票投资策略指通过对外延增长主题个股的持续跟踪,以研究员以及基金经理的实地调研、密切跟踪以及扎实的案头分析工作为基础,采用自上而下与自下而上相结合的选股策略,动态精选能够充分受益于外延增长为主题的优质股票进行投资。具体运作方法包括外延增长主题相关股票的界定和个股投资等方法。债券投资策略主要运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略等。
业绩比较基准	中证800指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等预期风险中等预期收益品种,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	-939,464.35
2.本期利润	14,915,224.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0443
4.期末基金资产净值	292,700,832.89
5.期末基金份额净值	1.0243

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、以上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(例如基金申购费赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

3、本基金合同生效日为2017年3月2日,至2017年9月30日披露日未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

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	4.79%	0.44%	3.09%	0.37%	1.70%	0.07%

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

新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年3月2日至2017年9月30日)

注:1、本基金自2017年3月2日成立,截至报告期末基金合同生效未满一年。

2、本报告期,本基金已完成建仓,各项资产配置比例符合本基金合同约定。

§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		
付伟	本基金基金经理,新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。	2017-03-02	-	7	西安交通大学工学硕士,北京大学工商管理硕士,7年证券从业经验。历任北京四方继保自动化股份有限公司项目经理;新华基金管理股份有限公司行业研究员,制造业与TMT组组长,先后负责新能源、机械、军工、汽车、通信、食品饮料等多个行业的研究。现任新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华优选成长混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华钻石品质企业混合型证券投资基金基金经理。

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,新华基金管理股份有限公司作为新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易,投资指令统一由交易部下达,并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议,由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会会议,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令,交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度市场各板块表现比较均衡,风格呈现多样化,成长股在季度初大幅探底之后,逐渐震荡向上,开始表现出较好的投资机会。本基金仓位较低,注重个股选择,精选具有外延增长预期的个股,长期持有,追求获取长期超额收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.0243元,本报告期份额净值增长率为4.79%,同期比较基准的增长率为3.09%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观数据显示,国内经济运行平稳,央行定向降准使得流动性边际改善。海外方面,美国减税计划有望落地,小企业减负明显。在供给侧改革推进取得明显成效之后,预期政府将在经济结构转型升级、发展新兴产业方面出台一定的鼓励政策,这将提升市场的风险偏好。

未来更多关注市场的结构性机会,重点布局安全边际与外延预期兼备的个股。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	172,375,899.36	58.31
	其中:股票	172,375,899.36	58.31
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	26,386,484.03	8.93
7	其他各项资产	96,850,772.41	32.76
8	合计	295,613,155.80	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,290,000.00	1.12
B	采矿业	39,793.60	0.01
C	制造业	81,756,585.58	27.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	4,017,150.00	1.37
F	批发和零售业	14,542,385.45	4.97
G	交通运输、仓储和邮政业	11,652,971.91	3.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,082,893.03	4.13
J	金融业	12,259,651.26	4.19
K	房地产业	5,589,000.00	1.91
L	租赁和商务服务业	7,199,724.72	2.46
M	科学研究和技术服务业	113,531.10	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	51,243.66	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.04
R	文化、体育和娱乐业	19,634,575.62	6.71
S	综合	-	-
	合计	172,375,899.36	58.89

5.3 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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000800	一汽轿车	500,000	6,880,000.00	2.35
2	002594	比亚迪	100,000	6,830,000.00	2.33
3	601688	华泰证券	300,073	6,787,651.26	2.32
4	000927	一汽夏利	1,000,000	5,780,000.00	1.97
5	600548	深高速	560,000	5,398,400.00	1.84
6	603708	家家悦	300,000	5,235,000.00	1.79
7	603728	鸣志电器	200,000	5,124,000.00	1.75
8	603900	通灵珠宝	150,000	5,037,000.00	1.72
9	300027	华谊兄弟	500,000	4,530,000.00	1.55
10	600373	中文传媒	200,074	4,425,636.88	1.51

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

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

本基金本报告期末无债券投资。

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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

本基金本报告期末无权证投资。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作,减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险;同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整,提高投资组合的运作效率。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2016年11月28日华泰证券收到中国证监会《行政处罚决定书》,经查明。华泰证券存在以下违法事实:截止调查日华泰证券有455个使用杭州恒生网络技术服务有限公司HOMS系统,61个使用浙江核新同花顺网络信息股份有限公司系统接入违规交易的主账户,对上述客户,华泰证券未按要求采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息,证监会对华泰证券给予警告,没收违法所得18,235,275.00元并处以54,705,825.00元罚款。

5.11.2本报告期,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	108,781.77
2	应收证券清算款	96,980,413.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-239,218.06
5	应收申购款	794.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,850,772.41

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000927	一汽夏利	5,780,000.00	1.97	筹划重大事项

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	368,276,413.65
报告期基金总申购份额	521,609.32
减:报告期基金总赎回份额	83,053,139.34
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	285,744,883.63

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未有影响投资者决策的其他重要信息。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(六)更新的《新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(七) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(八) 基金托管人业务资格批件及营业执照

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司
二〇一七年十月二十六日

新华壹诺宝货币市场基金

2017年第三季度报告

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华壹诺宝货币
基金主代码	000434
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月3日
报告期末基金份额总额	12,022,680,695.50份
投资目标	在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上,追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金采取以长期利率趋势分析为基础,结合短中期经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券类属配置和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资组合管理。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券基金,也低于混合型基金与股票型基金。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	新华壹诺宝 / 新华壹诺宝B
下属分级基金的交易代码	000434 / 003267
报告期末下属分级基金的份额总额	348,603,491.50份 / 11,674,077,204.00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2017年7月1日-2017年9月30日	
	新华壹诺宝	新华壹诺宝B
1.本期已实现收益	4,085,426.88	128,110,627.69
2.本期利润	4,085,426.88	128,110,627.69
3.期末基金资产净值	348,603,491.50	11,674,077,204.00

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

2.本基金利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、新华壹诺宝:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9854%	0.0005%	0.3408%	0.0000%	0.6446%	0.0005%

2、新华壹诺宝B:

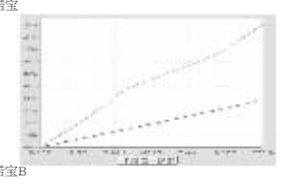
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0465%	0.0005%	0.3408%	0.0000%	0.7057%	0.0005%

注:本基金利润分配是按日结转份额。

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

新华壹诺宝货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年12月3日至2017年9月30日)

1、新华壹诺宝



2、新华壹诺宝B

注:1、报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

2、本基金于2016年10月24日分为A类(基金代码:000434)、B类(基金代码:003267)。

§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		
王崇	本基金基金经理,固定收益与平衡投资部副总监,新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理、新华同鑫一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华鑫安保本一年期开放式债券型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理、新华同盟一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理。	2015-06-11	-	8	经济学博士,注册金融分析师,历任中国建设银行北京分行投资银行部投资研究工作,中国工商银行资产管理部固定收益投资经理,2014年4月加入新华基金管理股份有限公司。现任新华基金管理股份有限公司固定收益与平衡投资部总监,新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理、新华同鑫一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。
姚秋	本基金基金经理,新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理、新华同盟一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2015-06-11	-	8	经济学博士,注册金融分析师,历任中国建设银行北京分行投资银行部投资研究工作。中国工商银行资产管理部固定收益投资经理,2014年4月加入新华基金管理股份有限公司。现任新华基金管理股份有限公司固定收益与平衡投资部总监,新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理、新华同鑫一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。
马英	本基金基金经理,新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理、新华同盟一年期定期开放债券型证券投资基金。	2015-07-10	2017-08-16	9	金融学硕士,9年证券从业经验。历任第一创业证券有限责任公司固定收益部业务董事,第一创业摩根大通证券有限责任公司投资银行部副总经理。2012年11月加入新华基金管理股份有限公司,历任固定收益部债券研究员、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理。现任新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理。
王滨	本基金基金经理,固定收益与平衡投资部副总监,新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理、新华同盟一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华添润添利货币市场基金基金经理。	2017-08-16	-	10	管理学硕士,10年证券从业经验。历任中国工商银行总行固定收益投资经理、中国民生银行投资经理、民生加银基金管理有限公司基金经理。2016年6月加入新华基金管理股份有限公司,现任固定收益与平衡投资部副总监、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金经理、新华添润添利货币市场基金基金经理。

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,新华基金管理股份有限公司作为新华壹诺宝货币市场基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华壹诺宝货币市场基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易,投资指令统一由交易部下达,并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易,交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议,由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会会议,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令,交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期,公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集,通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况,未发现重大异常情况,且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度,债券市场呈现震荡走势,资金价格波动率继续加大,一是由于国内二季度经济数据好于预期,二是外部经济体基本面持续走强,三是金融强监管政策思路明确。

本报告期内,本基金规模稳步增长,本基金依然秉持稳健投资原则谨慎操作,以确保组合安全性为首要任务,保障组合充足流动性,同时根据规模及配置时点合理调整各类资产配置比例,在提供充分流动性保证的情况下为持有人获取了较好的投资回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内A类(000434)基金份额净值收益率为0.9854%,同期业绩比较基准收益率为0.3408%,B类(003267)基金份额净值收益率为1.0465%,同期业绩比较基准收益率为0.3408%;

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为宏观经济短期内韧性较强,监管去杠杆政策效果已有所显现,后续推进或更为温和,货币政策将维持稳健中性。总体来看,债券市场经历长时间调整后绝对收益率水平相对提高,中短端配置价值较高,不过受内外部基本面及资金面制约,短期内长端收益率呈现趋势性下行的概率不大。

本基金在投资策略上将结合市场表现与流动性要求,采取较为灵活的策略应对收益率变化,重点把握资金面波动时点,投向存款、存单、回购和短融等,在提供充分的流动性保证的情况下为持有人获取更好的投资回报。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	336,488,255.50	15.30
	其中:股票	336,488,255.50	15.30
2	固定收益投资	1,796,437,847.00	81.61
	其中:债券	1,796,437,847.00	81.61
	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	-	-
	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	40,782,888.37	1.85
7	其他各项资产	27,225,275.56	1.24
8	合计	2,199,934,266.43	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	80,376,325.29	3.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,269,899.77	0.56
F	批发和零售业	43,500,251.15	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	2,353,548.75	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	105,282,532.18	4.79
K	房地产业	80,784,034.36	3.68
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,921,664.00	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	336,488,255.50	15.31

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	41.08	5.72
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	2.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	49.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	9.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	2.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		105.15	5.72

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内本基金未出现投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明。

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	507,954,925.88	4.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,782,507,086.73	48.10
8	其他	-	-
9	合计	6,380,462,012.61	53.07
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111711368	17平安银行CD068	2,500,000.00	248,398,735.23	2.07
2	111792774	17西安银行CD005	2,500,000.00	248,089,217.48	2.06
3	111799903	17汉口银行CD079	2,500,000.00	247,462,802.38	2.06
4	179935	17贴现国债35	2,000,000.00	199,638,097.03	1.66
5	111719220	17恒丰银行CD220	2,000,000.00	199,602,009.12	1.66
6	111784872	17佛山农商行CD014	2,000,000.00	198,257,193.86	1.65
7	111784759	17烟台银行CD023	2,000,000.00	198,165,017.54	1.65
8	111799962	17广东南粤银行CD032	2,000,000.00	197,910,418.88	1.65
9	111719218	17恒丰银行CD218	2,000,000.00	197,355,414.68	1.64
10	111786032	17珠海华润银行CD116	2,000,000.00	195,541,450.55	1.63

5.7"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0895%
报告期内偏离度的最低值	-0.0125%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0344%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内本基金未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内本基金未出现正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

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

报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

(1)基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际协议利率逐日计提利息;

(2)基金持有的回购协议(封闭式回购)以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;

(3)基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(4)基金持有的买断式回购以协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时,若双方都能履约,则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产,实际持有的相关资产按其性质进行估值;

(5)基金持有的资产支持证券视同债券,购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

5.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	21,096,012.03
4	应收申购款	56,211,258.87
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	77,307,270.90

5.9.4投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	新华壹诺宝	新华壹诺宝B
本报告期期初基金份额总额	365,045,676.00	10,037,403,909.52
报告期基金总申购份额	2,279,169,362.42	14,519,329,411.31
报告期基金总赎回份额	2,295,611,546.92	12,882,656,116.83
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	348,603,491.50	11,674,077,204.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华壹诺宝货币市场基金募集的文件

(二)关于申请募集新华壹诺