

新华壹诺宝货币市场基金
2016 年半年度报告
2016 年 6 月 30 日

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：二〇一六年八月二十四日

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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 8 月 23 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	13
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 债券回购融资情况.....	30
7.3 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	31
7.4 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.....	31
7.5“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	32
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	32
7.7 投资组合报告附注.....	32
8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	34
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	错误!未定义书签。
9 开放式基金份额变动	35
10 重大事件揭示	35
10.1 基金份额持有人大会决议.....	35

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	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	35
10.4 基金投资策略的改变	35
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	35
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	35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	35
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	37
10.9 其他重大事件	37
11 影响投资者决策的其他重要信息	39
12 备查文件目录	39
12.1 备查文件目录	39
12.2 存放地点	39
12.3 查阅方式	39

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华壹诺宝货币市场基金
基金简称	新华壹诺宝货币
基金主代码	000434
交易代码	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
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
报告期末基金份额总额	7,212,051,302.53 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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		新华基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	尹东
	联系电话	010-68779688	010-67595003
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		4008198866	010-67595096
传真		010-68779528	010-66275865
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		400010	100033

法定代表人	陈重	郭树清
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	102,635,391.17
本期利润	102,635,391.17
本期净值收益率	1.1248%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	7,212,051,302.53
期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	9.2774%

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.本基金于 2013 年 12 月 3 日基金合同生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	0.1750%	0.0020%	0.1107%	0.0000%	0.0643%	0.0020%
过去三个月	0.5466%	0.0022%	0.3362%	0.0000%	0.2104%	0.0022%
过去六个月	1.1248%	0.0023%	0.6736%	0.0000%	0.4512%	0.0023%
过去一年	2.3002%	0.0028%	1.3610%	0.0000%	0.9392%	0.0028%
自基金合同生效起至今	9.2774%	0.0070%	3.5397%	0.0000%	5.7377%	0.0070%

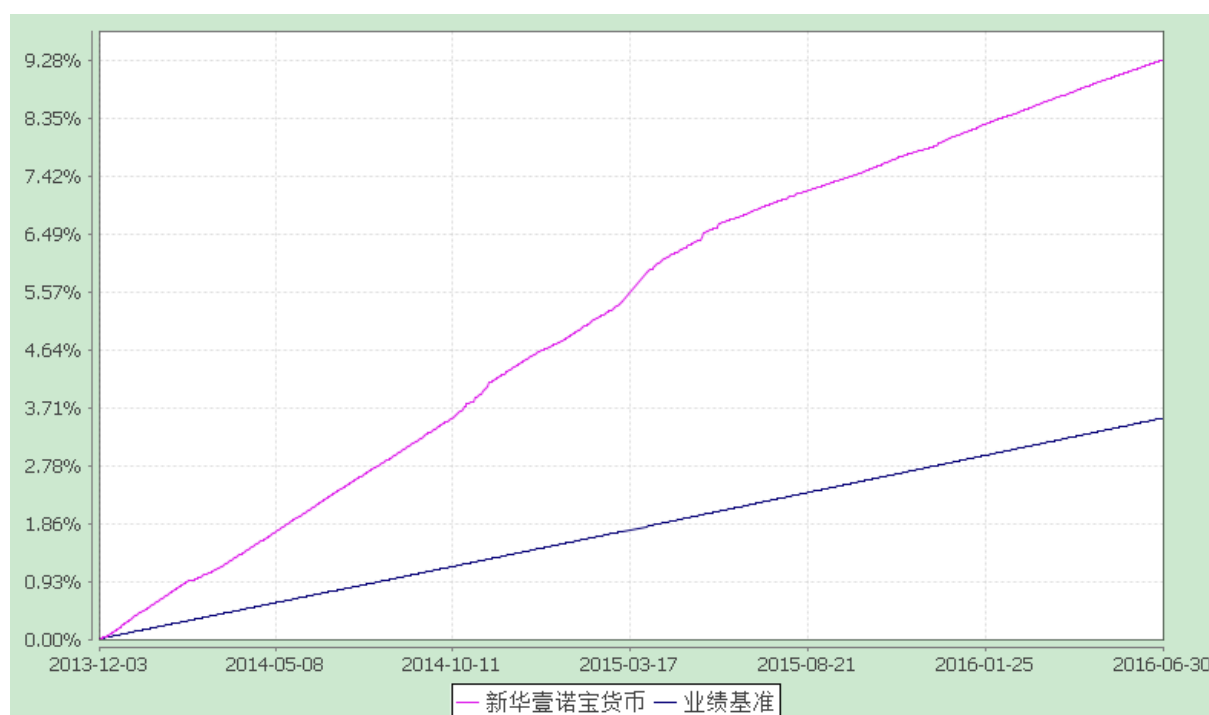
注：本基金利润分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额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

自基金合同生效以来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 2016 年 6 月 30 日)



注：报告期内本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着 35 只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华信用增益债券型证券投资基金、新华惠鑫分级债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华阿里一号保本混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华信用增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金和新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马英	本基金基金经理，新华活期添利货币市场基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华丰盈回报债券型证	2015-07-10	-	8	金融学硕士，8 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。现任新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理。

	券投资基金 基金基金 经理。				
--	----------------------	--	--	--	--

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券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，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 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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理有限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

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 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

回顾 2016 年上半年，经济增速换挡时期稳增长和调结构政策交替侧重，收益率维持区间震荡状态。一方面，基建投资托底经济，宽财政发力，去库存密集推行，经济短期呈现弱复苏格局，债市收益率下有底部保障。另一方面，宏观基本面中长期仍然缺乏新动能，经济下行风险依然存在，收益率上有顶部约束。

年初债市收益曲线陡峭化下移后，二季度短端利率上行导致曲线更为平坦。由于信用风险和局部流动性的冲击，1 年期国债和国开债上行约 30 个基点至 2.4% 和 2.6%。长端收益率呈倒 V 型走势，经济短期企稳、通胀上升推动长端收益率上行后，6 月基本面重回弱势，经济增长和金融数据低于预期，资金面维持稳定，海外动荡导致避险情绪上升，多重利好因素带动 10 年期国债和国开债回调至 2.84% 和 3.19%。

本基金二季度配置主要为短融、存款和回购，基金份额有所减少，收益率相对比较平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内基金份额净值收益率为 1.1248%，同期业绩比较基准收益率为 0.6736%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济“L”型格局下基本面预期变动不大，上半年总体信贷扩张较快，预计短期经济趋稳能持续。政策层面会采取宽财政、稳货币、紧信用的组合：财政、基建投资会继续托底经济；美国加息低于预期，但人民币中长期贬值担忧没有消除，货币政策进一步宽松面临汇率制约；信用层面，去杠杆监管加强，信用债发行规模显著下降，下半年信贷投放边际减少，需警惕企业再融资收缩和相应流动性风险冲击。

展望下半年，目前利率收益曲线非常平坦，期限利差已显著低于年初水平，除非基本面继续恶化倒逼货币政策放松并带动短端利率下降，否则长端无风险利率较难突破前低。考虑到供给仍会维持高位，并且汇率约束仍在，通胀预期跟年初收益低点比已抬升，长端利率债获利空间有限。信用债仍然会延续高低等级分化趋势，风险偏好没有回升，高等级信用债基本随利率债变动，中低等级仍然面临调整压力。

结合债券市场表现与流动性要求，本基金将采取较为灵活的策略应对市场变化，重点把握资金面波动时点，投向短融、存单和回购等，确保组合流动性，提高基金持有人的投资回报率。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工：

一、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

二、基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

三、投资管理部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；

- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

四、交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

五、监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人（该收益参与下一日的收益分配），并按工作日结转为相应的基金份额。报告期内，本基金实施利润分配的金额为 102,635,391.17 元。

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

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 102,635,391.17 元。

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

本托管人复核审查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。

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：新华壹诺宝货币市场基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,285,121,357.41	4,089,566,501.50
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	6,044,489,913.88	6,721,954,140.43
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,044,489,913.88	6,721,954,140.43
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	709,301,743.95
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	52,537,803.03	48,915,220.39
应收股利		-	-
应收申购款		60,612.60	138,001,401.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,382,209,686.92	11,707,739,007.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		164,999,797.50	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,187,432.27	2,153,755.96
应付托管费		662,858.23	652,653.32
应付销售服务费		1,657,145.75	1,631,633.27
应付交易费用	6.4.7.7	46,555.08	50,286.74
应交税费		-	-
应付利息		10,147.71	-
应付利润		356,706.61	965,346.23
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	237,741.24	469,200.00
负债合计		170,158,384.39	5,922,875.52
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	7,212,051,302.53	11,701,816,131.75
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		7,212,051,302.53	11,701,816,131.75
负债和所有者权益总计		7,382,209,686.92	11,707,739,007.27

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 7,212,051,302.53 份。

6.2 利润表

会计主体：新华壹诺宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		134,433,004.56	39,827,517.91
1.利息收入		113,053,224.67	31,618,633.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21,570,329.79	10,062,201.96
债券利息收入		83,589,593.14	19,525,681.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,893,301.74	2,030,750.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		21,379,779.89	8,208,884.50
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	21,379,779.89	8,208,884.50

资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、费用		31,797,613.39	6,379,910.17
1. 管理人报酬		15,064,956.77	2,732,390.04
2. 托管费		4,565,138.38	827,996.92
3. 销售服务费		11,412,846.07	2,069,992.54
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		454,235.56	466,260.81
其中：卖出回购金融资产支出		454,235.56	466,260.81
6. 其他费用	6.4.7.14	300,436.61	283,269.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		102,635,391.17	33,447,607.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		102,635,391.17	33,447,607.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华壹诺宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	11,701,816,131.75	-	11,701,816,131.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	102,635,391.17	102,635,391.17
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）	-4,489,764,829.22	-	-4,489,764,829.22
其中：1.基金申购款	8,656,011,793.22	-	8,656,011,793.22
2.基金赎回款	-13,145,776,622.44	-	-13,145,776,622.44
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）	-	-102,635,391.17	-102,635,391.17
五、期末所有者权益（基金净值）	7,212,051,302.53	-	7,212,051,302.53
项目	上年度可比期间		

	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	2,110,068,359.51	-	2,110,068,359.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,447,607.74	33,447,607.74
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）	2,204,348,833.10	-	2,204,348,833.10
其中：1.基金申购款	15,173,971,207.27	-	15,173,971,207.27
2.基金赎回款	-12,969,622,374.17	-	-12,969,622,374.17
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）	-	-33,447,607.74	-33,447,607.74
五、期末所有者权益（基金净值）	4,314,417,192.61	-	4,314,417,192.61

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：

基金管理人负责人：陈重，主管会计工作负责人：张宗友，会计机构负责人：徐端骞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华壹诺宝货币市场基金(以下简称“本基金”)系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[2013]1359号文核准，由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于2013年11月25日至2013年11月29日向社会公开募集，设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计409,018,569.10份，有效认购户数为288户，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2013]第404A0017号验资报告予以验证。2013年12月3日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不限定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《新华壹诺宝货币市场基金招募说明书》及《新华壹诺宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的货币市场工具，主要包括以下：现金；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天以内（含397天）的债券、资产支持证券、中期票据；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于2016年8月23日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华壹诺宝货币市场基金基金合同》和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定进行确认、计量和编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制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的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致，所采用的会计政策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

本基金报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税,暂不征收企业所得税。

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 2016年6月30日
活期存款	10,921,357.41
定期存款	1,274,200,000.00
其中:存款期限 1-3 个月	1,013,000,000.00
存款期限 1 个月以内(含 1 个月)	11,200,000.00
存款期限大于 3 个月	250,000,000.00
其他存款	-
合计	1,285,121,357.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2016年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	6,044,489,913.88	6,052,132,000.00	7,642,086.12	0.11
	合计	6,044,489,913.88	6,052,132,000.00	7,642,086.12	0.11

注:1、偏离金额=影子定价-摊余成本

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末,本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,013.36
应收定期存款利息	2,356,116.26
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	50,179,673.41
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	52,537,803.03

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	46,555.08
合计	46,555.08

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	39,781.56
预提信息披露费	188,959.68
预提账户维护费	9,000.00
合计	237,741.24

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,701,816,131.75	11,701,816,131.75
本期申购	8,656,011,793.22	8,656,011,793.22
本期赎回（以“-”号填列）	-13,145,776,622.44	-13,145,776,622.44
本期末	7,212,051,302.53	7,212,051,302.53

注：申购含红利再投份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	0.00	-	-
本期利润	102,635,391.17	-	102,635,391.17
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-102,635,391.17	-	-102,635,391.17
本期末	-	-	-

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	63,209.24
定期存款利息收入	21,507,120.55
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	0.00
其他	-
合计	21,570,329.79

6.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,320,961,103.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,195,936,042.85
减：应收利息总额	103,645,281.13
买卖债券差价收入	21,379,779.89

6.4.7.12 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	0.00
银行间市场交易费用	-
合计	-

6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	188,959.68
汇划手续费	53,290.37
其他	5.00
账户维护费	18,100.00
证书使用费	300.00
合计	300,436.61

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东

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****6.4.10.1.1 股票交易**

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，基金均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金均无应支付关联方的佣金。

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,064,956.77	2,732,390.04
其中：支付销售机构的客户维护费	87,779.90	77,159.38

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率逐日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

其中列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,565,138.38	827,996.92

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.10% 的年费率逐日计提确认。

其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

新华基金管理股份有限公司	10,860,966.11
恒泰证券	508,324.86
建设银行	1,041.16
合计	11,370,332.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
新华基金管理股份有限公司	1,636,524.14
恒泰证券	390,375.80
合计	2,026,899.94

注：本基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/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

本报告期及上年度可比期间，本报告期末进行银行间债券(含回购)交易。

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 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
期初持有的基金份额	0.00	-
期间申购/买入总份额	100,000,000.00	-
期间因拆分变动份额	467,020.10	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	100,467,020.10	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.39%	-

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

报告期末，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 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国建设银行	10,921,357.41	63,209.24	10,099,350.71	38,607.70

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
103,244,030.79	-	-608,639.62	102,635,391. 17	-

6.4.12 期末（2016 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

截止报告期期末，本基金未持有因认购新发/增发证券流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至报告期期末，本基金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

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金从事银行间市场债券正回购形成的卖出回购金融资产款余额为 164,999,797.5 元，于 2016 年 7 月 1 日全部到期。该类交易要求基金转入质押库的债券，按银行间市场所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
160401	16 农发 01	2016-07-01	99.84	1,650,000.00	164,736,000.00
合计				1,650,000.00	164,736,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至 2016 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会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、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

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 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
A-1	4,567,550,000.00	2,729,989,000.00
A-1 以下	0.00	-
未评级	850,055,000.00	2,808,540,000.00
合计	5,417,605,000.00	5,538,529,000.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大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。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资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折

现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月 30日	6个月以内	6个月-1年	1年以内	1-5年	不计息	合计
资产						
银行存款	-	-	1,285,121,357.41	-	-	1,285,121,357.41
交易性金融资产	-	-	6,044,489,913.88	-	-	6,044,489,913.88
应收利息	-	-	-	-	52,537,803.03	52,537,803.03
应收申购款	-	-	-	-	60,612.60	60,612.60
资产总计	-	-	7,329,611,271.29	-	52,598,415.63	7,382,209,686.92
负债						
卖出回购金融资产款	-	-	164,999,797.50	-	-	164,999,797.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,187,432.27	2,187,432.27
应付托管费	-	-	-	-	662,858.23	662,858.23
应付销售服	-	-	-	-	1,657,145.75	1,657,145.75

务费						5
应付交易费用					46,555.08	46,555.08
应付利息					10,147.71	10,147.71
应付利润					356,706.61	356,706.61
其他负债					237,741.24	237,741.24
负债总计		-	164,999,797.50		5,158,586.89	170,158,384.39
利率敏感度缺口			7,164,611,473.79		47,439,828.74	7,212,051,302.53
上年度末 2015 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	不计息	合计
资产						
银行存款			4,089,566,501.50			4,089,566,501.50
交易性金融资产			6,721,954,140.43			6,721,954,140.43
买入返售金融资产			709,301,743.95			709,301,743.95
应收利息					48,915,220.39	48,915,220.39
应收申购款					138,001,401.00	138,001,401.00
资产总计			11,520,822,385.88		186,916,621.39	11,707,739,007.27
负债						
应付管理人报酬					2,153,755.96	2,153,755.96
应付托管费					652,653.32	652,653.32
应付销售服务费					1,631,633.27	1,631,633.27
应付交易费用					50,286.74	50,286.74
应付利润					965,346.23	965,346.23
其他负债					469,200.00	469,200.00
负债总计					5,922,875.52	5,922,875.52
利率敏感度缺口			11,520,822,385.88		180,993,745.87	11,701,816,131.75

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点
	其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
		市场利率上升 25.00 bp	增加约 1,791
市场利率下降 25.00 bp	减少约 1,791	减少约 2,880	

注：本基金管理人运用 XRisk Suite 风险控制系统对本基金投资组合中的银行存款、结算备付金、存出保证金和债券类资产做出以上利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。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、央行票据、地方政府债、城投债、金融债、企业债（含中小企业私募债）短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，同时本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产也不参与一级市场新股申购和新股增发和可转债投资。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	6,052,132,000.00	83.92	6,732,184,000.00	57.53
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,052,132,000.00	83.92	6,732,184,000.00	57.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,本基金业绩比较基准上升 1%		
	其他市场变量不变,本基金业绩比较基准下降 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	本基金业绩比较基准上升 1%	减少约 22	减少约 34
	本基金业绩比较基准下降 1%	增加约 22	增加约 34

注: 本基金管理人运用 XRisk suite 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价格风险的敏感性分析。

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	固定收益投资	6,044,489,913.88	81.88
	其中: 债券	6,044,489,913.88	81.88
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	1,285,121,357.41	17.41

4	其他各项资产	52,598,415.63	0.71
5	合计	7,382,209,686.92	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.46	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	164,999,797.50	2.29
	其中：买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	75
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金合同约定“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”，本报告期内，本基金未发生投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

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	22.21	2.29
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	31.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	27.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
4	90 天（含）—120 天	5.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	14.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	101.63	2.29

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	849,716,676.46	11.78
	其中：政策性金融债	849,716,676.46	11.78
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,560,231,488.30	63.23
6	中期票据	-	-
7	同业存单	634,541,749.12	8.80
8	其他	-	-
9	合计	6,044,489,913.88	83.81
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	150419	15 农发 19	3,000,000.00	300,123,106.67	4.16
2	160401	16 农发 01	3,000,000.00	299,526,794.27	4.15
3	011599971	15 皖交控 SCP005	2,000,000.00	200,156,956.04	2.78
4	071602003	16 国泰君安 CP003	2,000,000.00	199,966,515.01	2.77
5	071603003	16 中信 CP003	1,500,000.00	149,984,313.58	2.08
6	011537011	15 中建材 SCP011	1,200,000.00	120,042,024.89	1.66

7	071603004	16 中信 CP004	1,200,000.00	119,983,367.23	1.66
8	011599975	15 首旅 SCP006	1,000,000.00	100,142,647.34	1.39
9	071630002	16 财通证券 CP002	1,000,000.00	99,998,607.32	1.39
10	071626001	16 兴业银行 CP001	1,000,000.00	99,997,108.61	1.39

7.6“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
报告期内偏离度的最高值	0.1208%
报告期内偏离度的最低值	0.0389%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0880%

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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本报告期内，本基金未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过 0.5% 的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7.8.2 2015 年 11 月 26 日，16 中信 CP001 的发行主体中信证券收到中国证监会调查通知书，其中提及，因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，证监会决定对公司进行立案侦查。该事项对于该债券的偿付未构成实质性影响。

2016 年 1 月 29 日，中小企业股份转让系统有限责任公司就 2015 年 12 月 31 日国泰君安在新三板做市业务中的异常报价行为给予公开谴责并对公司相关人员进行公开谴责和通报批评。

2016 年 2 月 26 日，国泰君安公司收到上海监管局监管，公司场外市场部做市业务部门的绩效考核体系、内部管理与控制等方面存在重大缺陷，违反了《中国证监会关于进一步推进全国中小企业股份转让系统发展的若干意见》。

2016 年 6 月 16 日，国泰君安期货有限公司收到证监会《调查通知书》因未能有效履行资产管理人职责，根据规定，对公司进行立案侦查。

2016 年 2 月 18 日，兴业证券收到证监会警示函，经查，2015 年 7 月 7 日融资融券强制平仓操作出现差错，导致客户信用账户股票的实际强制平仓数量远超过应当平仓数量，7 月 8 日，公司未经客户同意直接在客户信用账户进行买回操作。

2016 年 7 月 9 日，兴业证券披露《兴业证券股份有限公司关于收到行政处罚及市场禁入事先告知书》，公司在推荐欣泰电器在创业板 IPO 过程中未遵守行业规则和规范，报送文件存在虚假记载，未发现《招股意向书》《招股说明书》中涉及欣泰电器应收账款、流动资产、和经营活动产生现金流量净额等项目的财务数据存在虚假记载，证监会决定对公司给予警告，没收保荐收入 1200 万元，并处以 2400 万元罚款，没收承销股票非法所得 2078 万元并处 60 万元罚款，对兰翔、伍文祥先生分别采取 10 年证券市场禁入措施。

除以上提到的证券外，本基金投资的其余前十名发行主体本期未发生被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内公开谴责、处罚的情形。

7.8.3 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	应收证券清算款	-
3	应收利息	52,537,803.03
4	应收申购款	60,612.60
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	52,598,415.63

7.8.4 其他需说明的重要事项

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。

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

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
30,652	235,288.12	6,870,737,811.25	95.27%	341,313,491.28	4.73%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,322,304.69	0.02%

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 3 日）基金份额总额	409,018,569.10
本报告期期初基金份额总额	11,701,816,131.75
本报告期基金总申购份额	8,656,011,793.22
减：本报告期基金总赎回份额	13,145,776,622.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,212,051,302.53

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

2016 年 3 月 24 日，崔建波先生担任基金管理人副总经理。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所的情况。

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，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

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	
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-

东北证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）以及《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）的有关规定，本基金报告期内共租用 16 个交易席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

- 3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

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		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
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 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	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2015 年年度资产净值的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-04
2	新华壹诺宝货币市场基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-22
3	新华壹诺宝货币市场基金招募说明书更正公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-01-22
4	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基	中国证券报、证券时报、	2016-02-18

	金增加中证金牛为代销机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、 公司网站	
5	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为代销机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-03-01
6	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加金观诚为代销机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-03-15
7	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-03-25
8	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加新兰德开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-03-26
9	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加众禄基金开展的基金申（认）购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-03-28
10	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-03-29
11	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰为销售机构并参加网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-04-16
12	新华基金管理股份有限公司关于“银联通”渠道开通部分银行借记卡网上直销业务功能的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-04-20
13	新华壹诺宝货币市场基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-04-21
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-04-25
15	新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销系统招商银行网银支付费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-04-29
16	新华基金管理股份有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-05-05
17	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-06-06
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2016-06-13

19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2016-06-13
----	--	----------------------------	------------

11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 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宝货币市场基金之法律意见书
- (三) 新华壹诺宝货币市场基金托管协议
- (四) 新华壹诺宝货币市场基金基金合同
- (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《新华壹诺宝货币市场基金招募说明书》
- (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
- (九) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (十) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 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

二〇一六年八月二十四日