

新华壹诺宝货币市场基金

2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 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：二〇二〇年三月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 25 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 错误!未定义书签。 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 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..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 15 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 16 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 18 |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明..... | 错误!未定义书签。 |
| §5 托管人报告 | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 18 |
| 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..... | 18 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 19 |
| §6 审计报告 | 错误!未定义书签。 |
| 6.1 管理层对财务报表的责任..... | 错误!未定义书签。 |
| 6.2 注册会计师的责任..... | 错误!未定义书签。 |
| 6.3 审计意见..... | 错误!未定义书签。 |
| §7 年度财务报表 | 19 |
| 7.1 资产负债表..... | 21 |
| 7.2 利润表..... | 22 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 24 |
| 7.4 报表附注..... | 25 |
| §8 投资组合报告 | 51 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 51 |
| 8.2 债券回购融资情况..... | 51 |
| 8.3 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 错误!未定义书签。 |
| 8.4 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..... | 错误!未定义书签。 |
| 8.5“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离..... | 错误!未定义书签。 |
| 8.6 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..... | 错误!未定义书签。 |

| | |
|--|-----------|
| 8.7 投资组合报告附注 | 错误!未定义书签。 |
| §9 基金份额持有人信息 | 55 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 55 |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 | 错误!未定义书签。 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 55 |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 错误!未定义书签。 |
| §10 开放式基金份额变动 | 56 |
| §11 重大事件揭示 | 57 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 57 |
| 11.2 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 | 57 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 57 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 57 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 错误!未定义书签。 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 错误!未定义书签。 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 57 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 | 59 |
| 11.9 其他重大事件 | 59 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 错误!未定义书签。 |
| §13 备查文件目录 | 61 |
| 13.1 备查文件目录 | 62 |
| 13.2 存放地点 | 62 |
| 13.3 查阅方式 | 62 |

§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 | |
| 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 | 2,260,144,261.52 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 新华壹诺宝 A | 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 | 459,271,151.58 份 | 1,800,873,109.94 份 |

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 | 田青 |
| | 联系电话 | 010-68779688 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | qiyan@ncfund.com.cn | tianqing1.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 | | 张宗友 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ncfund.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
|--------|------------------|--------------------------------------|
| 会计师事务所 | 瑞华会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 11 层 |
| 注册登记机构 | 新华基金管理股份有限公司 | 重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层 |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2019 年 | 2018 年 | 2017 年 |
|--------------|--------|--------|--------|
|--------------|--------|--------|--------|

| 标 | 新华壹诺 宝 A | 新华壹诺 宝 B | 新华壹诺 宝 A | 新华壹诺 宝 B | 新华壹诺 宝 A | 新华壹诺 宝 B |
|----------------------|----------------|------------------|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 本期已实现收益 | 12,607,550.04 | 115,484,548.60 | 17,491,118.90 | 374,323,245.22 | 17,713,233.50 | 459,717,997.05 |
| 本期利润 | 12,607,550.04 | 115,484,548.60 | 17,491,118.90 | 374,323,245.22 | 17,713,233.50 | 459,717,997.05 |
| 本期净值收益率 | 2.3132% | 2.5590% | 3.4132% | 3.6620% | 3.8572% | 4.1072% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年末 | | 2018 年末 | | 2017 年末 | |
| | 新华壹诺宝 A | 新华壹诺宝 B | 新华壹诺宝 A | 新华壹诺宝 B | 新华壹诺宝 A | 新华壹诺宝 B |
| 期末基金资产净值 | 459,271,151.58 | 1,800,873,109.94 | 397,252,040.10 | 11,270,869,710.78 | 615,861,834.51 | 14,808,927,750.81 |
| 期末基金份额净值 | 1.000 | 1.000 | 1.000 | 1.000 | 1.000 | 1.000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2019 年末 | | 2018 年末 | | 2017 年末 | |
| | 新华壹诺 宝 A | 新华壹诺 宝 B | 新华壹诺 宝 A | 新华壹诺 宝 B | 新华壹诺 宝 A | 新华壹诺 宝 B |
| 累计净值收益率 | 21.5968% | 11.3206% | 18.8475% | 8.5430% | 14.9249% | 4.7085% |

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

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

1. 新华壹诺宝 A:

| 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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.5774% | 0.0002% | 0.3408% | 0.0000% | 0.2366% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 1.1077% | 0.0006% | 0.6829% | 0.0000% | 0.4248% | 0.0006% |

| | | | | | | |
|----------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去一年 | 2.3132% | 0.0020% | 1.3591% | 0.0000% | 0.9541% | 0.0020% |
| 过去三年 | 9.8866% | 0.0033% | 4.1331% | 0.0000% | 5.7535% | 0.0033% |
| 过去五年 | 16.2113% | 0.0050% | 6.9829% | 0.0000% | 9.2284% | 0.0050% |
| 自基金成立起至今 | 21.5968% | 0.0052% | 8.5533% | 0.0000% | 13.0435% | 0.0052% |

2. 新华壹诺宝 B:

| 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 |
|----------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.6383% | 0.0002% | 0.3408% | 0.0000% | 0.2975% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 1.2302% | 0.0006% | 0.6829% | 0.0000% | 0.5473% | 0.0006% |
| 过去一年 | 2.5590% | 0.0020% | 1.3591% | 0.0000% | 1.1999% | 0.0020% |
| 过去三年 | 10.6813% | 0.0033% | 4.1331% | 0.0000% | 6.5482% | 0.0033% |
| 自基金成立起至今 | 11.3206% | 0.0033% | 4.3984% | 0.0000% | 6.9222% | 0.0033% |

注：1、本基金利润分配是按日结转份额。

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）。

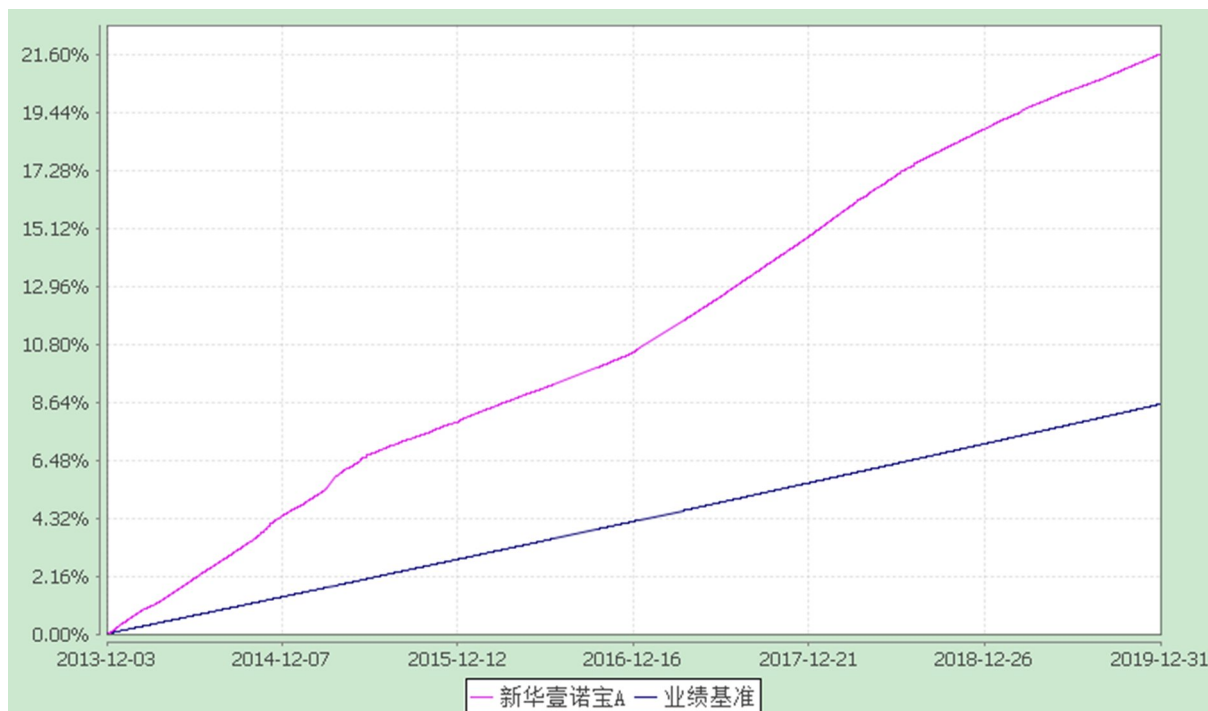
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华壹诺宝货币市场基金

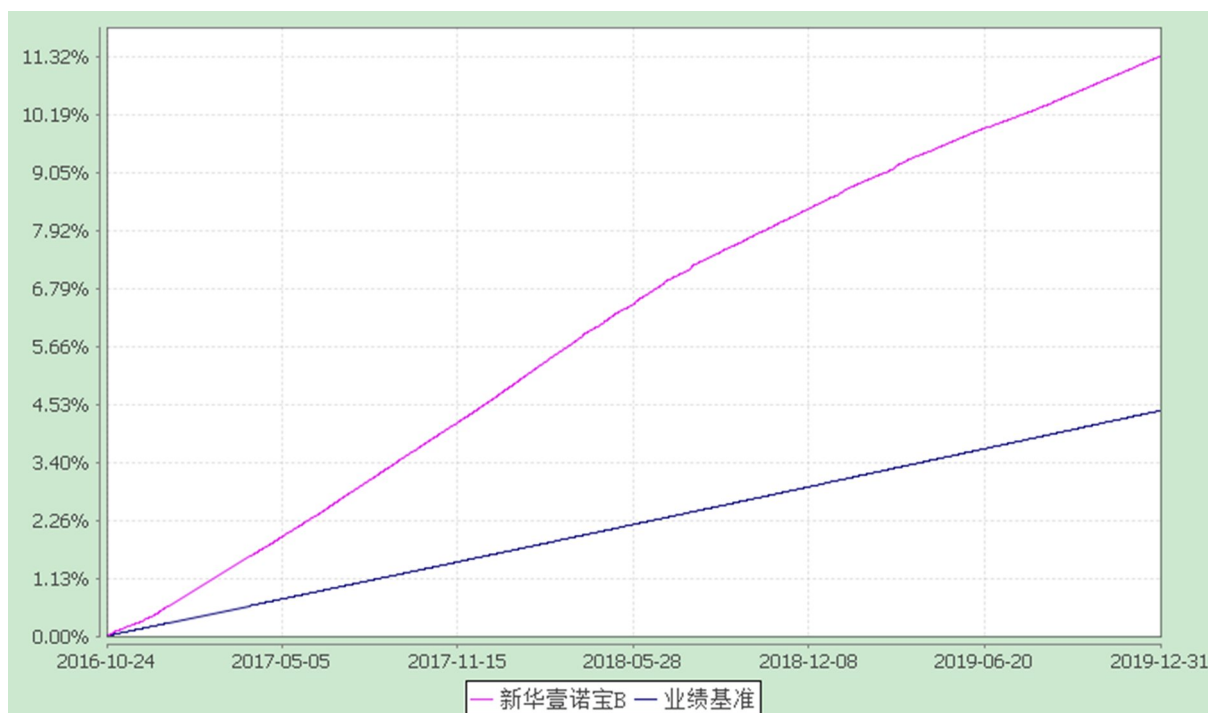
自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 12 月 3 日至 2019 年 12 月 31 日)

1、新华壹诺宝 A



2、新华壹诺宝 B



注：1、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。

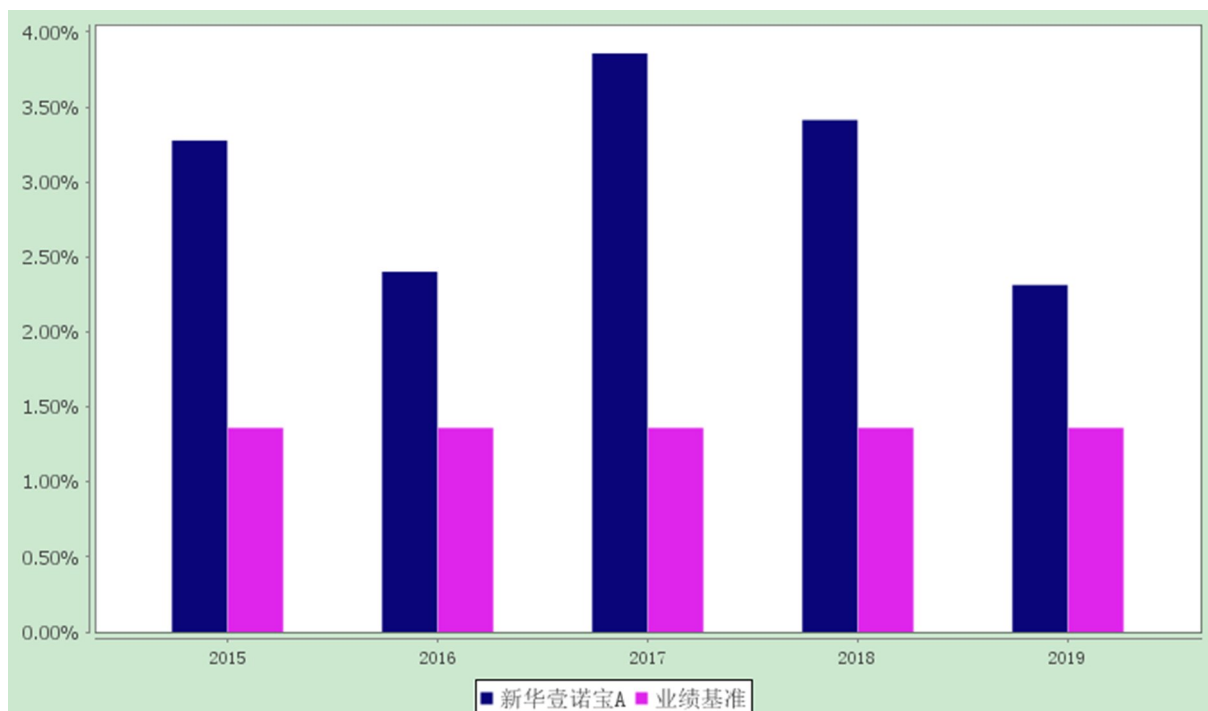
2、本基金于 2016 年 10 月 24 日分为 A 类（基金代码：000434）、B 类（基金代码：003267）。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

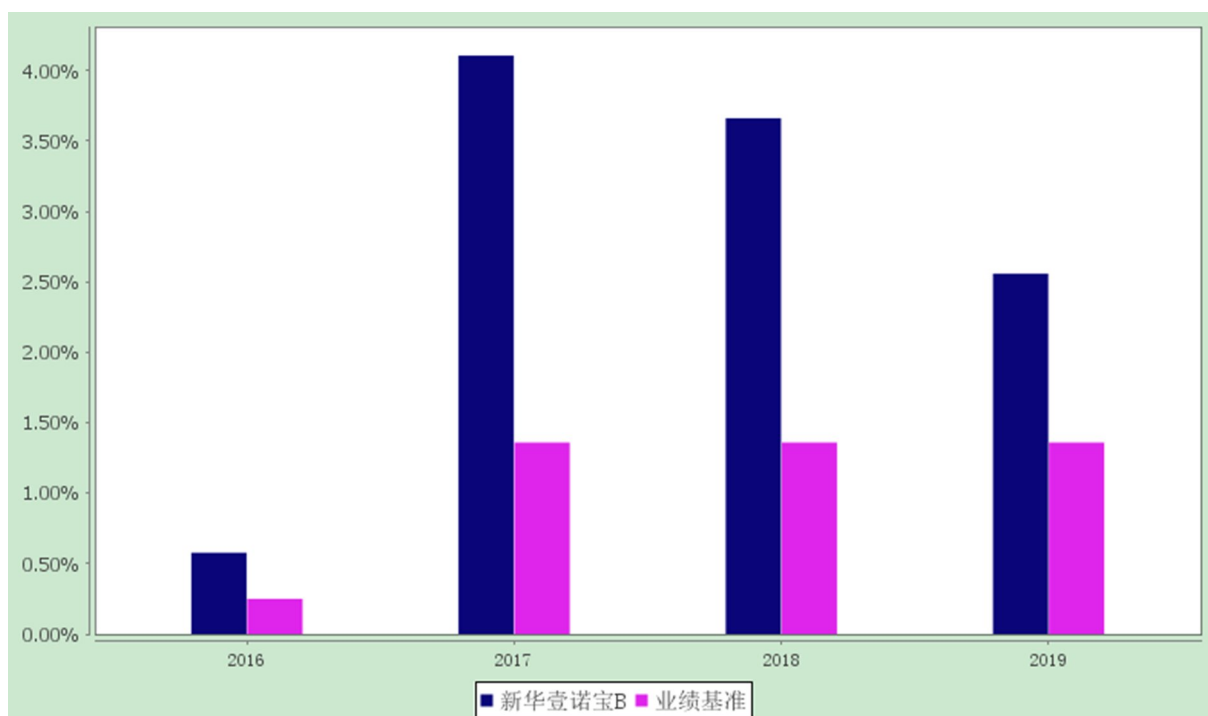
新华壹诺宝货币市场基金

过去五年基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1、新华壹诺宝 A



2、新华壹诺宝 B



注：1、本基金于 2013 年 12 月 3 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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）。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

新华壹诺宝 A:

单位: 人民币元

| 年度 | 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 | 年度利润分配合 计 | 备注 |
|------|----------------------|-------------------|-------------|---------------|----|
| 2017 | 17,641,113.1 9 | - | 72,120.31 | 17,713,233.50 | - |
| 2018 | 17,580,865.1 4 | - | -89,746.24 | 17,491,118.90 | - |
| 2019 | 12,698,644.6 5 | - | -91,094.61 | 12,607,550.04 | - |
| 合计 | 47,920,622.9 8 | - | -108,720.54 | 47,811,902.44 | - |

新华壹诺宝 B:

单位: 人民币元

| 年度 | 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 | 年度利润分配合 计 | 备注 |
|------|----------------------|-------------------|---------------|----------------|----|
| 2017 | 457,420,904. 16 | - | 2,297,092.89 | 459,717,997.05 | - |
| 2018 | 375,949,255. 73 | - | -1,626,010.51 | 374,323,245.22 | - |
| 2019 | 119,070,499. 31 | - | -3,585,950.71 | 115,484,548.60 | - |
| 合计 | 952,440,659. 20 | - | -2,914,868.33 | 949,525,790.87 | - |

注: 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 2019 年 12 月 31 日,新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十四只开放式基金,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、新华增怡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、新华鑫利灵活配置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、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金。

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 | | |
| 王滨 | 本基金基金经理, 固定收益与平衡投资部副总监、新华活期添利货币市场 | 2017-07-13 | - | 12 | 管理学硕士, 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、新华基金管理股份有限公司投资经理。 |

| | | | | | |
|----|--|------------|---|---|-----------------------|
| | 基金基金经理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理、新华恒稳添利债券型证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华精选低波动股票型证券投资基金基金经理。 | | | | |
| 李洁 | 本基金基金经理助理，新华活期添利货币市场基金基金经理助理。 | 2017-03-07 | - | 5 | 经济学硕士，历任中债信用业务经理、高级经理 |

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 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定。基金管理人对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明：债券同向交易频率偏低；股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断，即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大，结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，本报告期内，未发生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 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

2019 年四季度宏观经济呈现弱企稳态势，年底经济数据略有改善，在社融和 PMI 等数据持续小

幅回升的情况下，逆周期调控政策仍在延续。财政政策方面，财政部提前下达了新一年的专项债额度。货币政策进一步宽松，央行调降 MLF 操作利率和公开市场逆回购操作利率，LPR 跟随下调，引导实体融资成本下行。长债收益率一直处于慢牛状态，信用债市场结构分化继续，瑕疵企业违约事件不断，优质企业收益率仍维持低位，信用利差小幅变化。

本报告期内，本基金规模较为稳定，本基金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 2.3132%，同期业绩比较基准收益率为 1.3591%，B 类（003267）基金份额净值收益率为 2.5590%，同期业绩比较基准收益率为 1.3591%；

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 2020 年全年，突发疫情黑天鹅影响对前期弱复苏的经济态势产生了较为严重的影响，同时海外方面也存在疫情持续扩散的可能，整体全球各类经济活动受损情况可能在目前尚难量化。

春节后 10Y 国债收益率水平快速下行，A 股中的创业板也在悲观情绪释放后出现了短期内连续上涨。其中主线我们认为在于短期经济受到较大冲击，而意在呵护经济的货币政策又带来了整体流动性充裕。相比非典时期，此次停工的企业几乎遍布全国，同时海外的不确定性也依然很强，预计国内需要普遍性的引导贷款利率更大力度的下调，同时配合其他政策综合运用，才能更好地帮助企业渡过难关，预计货币政策的宽松取向会相对较明确，整体环境将对债市相对友善。另一方面，春节后这波债市行情走的过急过快，大家对于债市的调整是否已经一步到位存有疑虑，但从国内外绝对收益率水平的横向比较来看，未来一段时间内债市收益率预计仍有进一步下降空间，但展望全年仍然不确定性较强。

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，投向存单、存款、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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督

促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定的要求，完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

二、督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

三、根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

四、在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部对公司员工进行了法律法规的专项培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

通过上述工作，在本报告期内，公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.7.1.1 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。

4.7.1.2 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。

4.7.1.3 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讯；

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。

4.7.1.4 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。

4.7.1.5 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。

4.8 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 A 类（000434）实施利润分配的金额为 12,607,550.04 元，B 类（003267）实施利润分配的金额为 115,484,548.60 元。

4.9 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遵规守信、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 A 类份额实施利润分配的金额为 12,607,550.04 元，B 类份额实施利润分配的金额为 115,484,548.60 元。

5.3 托管人对本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 审计报告

瑞华审字【2020】36010002 号

新华壹诺宝货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了新华壹诺宝货币市场基金（以下简称“新华壹诺宝基金”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表、2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了新华壹诺宝货币市场基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于新华壹诺宝基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

新华壹诺宝基金的管理人新华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括新华壹诺宝基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估新华壹诺宝基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算新华壹诺宝基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督新华壹诺宝基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误所导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计的过程中，我们运用了职业判断，并保持了职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对新华壹诺宝基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致新华壹诺宝基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

吕金保 姜明明

北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 11 层

2020 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 614,363,194.27 | 1,217,579,262.47 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,015,126,924.48 | 6,703,986,786.66 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,015,126,924.48 | 6,703,986,786.66 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 616,248,690.57 | 3,627,506,485.80 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 3,493,137.10 | 17,180,803.29 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 100,429,699.64 | 109,905,310.31 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |

| 资产总计 | | 2,349,661,646.06 | 11,676,158,648.53 |
|-------------------|----------|-------------------------|--------------------------|
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 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 | | 88,064,667.90 | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 701,449.44 | 2,589,027.00 |
| 应付托管费 | | 212,560.43 | 784,553.64 |
| 应付销售服务费 | | 117,416.97 | 171,569.45 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 47,759.14 | 110,209.59 |
| 应交税费 | | 743.93 | 79,930.52 |
| 应付利息 | | 8,224.60 | - |
| 应付利润 | | 155,562.13 | 3,832,607.45 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 209,000.00 | 469,000.00 |
| 负债合计 | | 89,517,384.54 | 8,036,897.65 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 2,260,144,261.52 | 11,668,121,750.88 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 2,260,144,261.52 | 11,668,121,750.88 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,349,661,646.06 | 11,676,158,648.53 |

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，A 类(000434)基金份额净值 1.000 元，基金份额 459,271,151.58 份；B 类（003267）基金份额净值 1.000 元基金份额 1,800,873,109.94 份。

7.2 利润表

会计主体：新华壹诺宝货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|---|--|
| 一、收入 | | 154,475,006.29 | 445,911,939.43 |
| 1.利息收入 | | 152,828,847.17 | 442,064,810.39 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 26,000,146.85 | 43,132,596.15 |
| 债券利息收入 | | 84,749,689.99 | 226,197,959.99 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 42,079,010.33 | 172,734,254.25 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 1,646,159.12 | 3,847,129.04 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.14 | 1,646,159.12 | 3,847,129.04 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.17 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.19 | - | - |
| 减：二、费用 | | 26,382,907.65 | 54,097,575.31 |
| 1. 管理人报酬 | | 16,606,956.17 | 35,687,947.60 |
| 2. 托管费 | | 5,032,410.94 | 10,814,529.64 |
| 3. 销售服务费 | | 1,826,863.93 | 2,337,993.75 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.21 | - | 300.00 |
| 5. 利息支出 | | 2,560,084.41 | 4,556,755.46 |

| | | | |
|----------------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 2,560,084.41 | 4,556,755.46 |
| 6. 税金及附加 | | 21,846.39 | 79,570.51 |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.22 | 334,745.81 | 620,478.35 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 128,092,098.64 | 391,814,364.12 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 128,092,098.64 | 391,814,364.12 |

7.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|--|----------------------------------|-----------------|--------------------|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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） | 11,668,121,750.88 | - | 11,668,121,750.88 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 128,092,098.64 | 128,092,098.64 |
| 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） | -9,407,977,489.36 | - | -9,407,977,489.36 |
| 其中：1.基金申购款 | 25,440,493,741.62 | - | 25,440,493,741.62 |
| 2.基金赎回款 | -34,848,471,230.98 | - | -34,848,471,230.98 |
| 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） | - | -128,092,098.64 | -128,092,098.64 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,260,144,261.52 | - | 2,260,144,261.52 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |

| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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） | 15,424,789,585.32 | - | 15,424,789,585.32 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 391,814,364.12 | 391,814,364.12 |
| 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） | -3,756,667,834.44 | - | -3,756,667,834.44 |
| 其中：1.基金申购款 | 74,393,921,928.58 | - | 74,393,921,928.58 |
| 2.基金赎回款 | -78,150,589,763.02 | - | -78,150,589,763.02 |
| 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） | - | -391,814,364.12 | -391,814,364.12 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 11,668,121,750.88 | - | 11,668,121,750.88 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张宗友，主管会计工作负责人：刘全胜，会计机构负责人：徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 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《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》、《货币市场基金监督管理办法》及《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的规定及本基金基金合同和招募说明书的约定，为满足投资者的理财需求，经与本基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，新华基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”)决定自 2016 年 10 月 24 日起增加 B 类基金份额，并对本基金基金合同和托管协议进行修改。

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、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场分类。

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 2020 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 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，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 42 项具体会计准则、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》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。此外，本基金财务报表在所有重大方面符合中国证券监督管理委员会颁布的《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>》中有关财务报表及其附注的披露要求。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

（2）回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以使用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

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。

本基金金融工具的估值方法具体如下：

（1）银行存款

本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）债券投资

本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；

（3）回购协议

本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；

本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；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

(4) 其他

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方法估值；

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标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，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过 0.50% 的情形，基金管理人应编制并披露临时报告。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

(2) 投资收益

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

（3）其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

（1）基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提；

（2）基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提；

（3）基金 A 类销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提，B 类销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 年费率计提；

（4）卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

（5）其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

（1）每一基金份额享有同等的分配权；

（2）本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

（3）本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付；

（4）本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

（5）当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

（6）本基金每个开放日公告前一个开放日每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个自然日，披露节假日期间的每万份基金已实现收益和节假日最后一日的 7 日年化收益率，以及节假日后首个开放日的每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。依据本合同的约定经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。法律法规另有规定的，从其规定。

（7）本基金每日例行对当天实现的收益进行收益结转（如遇节假日顺延），每日例行的收益结转不再另行公告。

(8)法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算“影子价格”过程中确定债券投资或资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种（含上交所可交换债），选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值净价作为公允价值。

对在交易所市场上市交易的可转换债券（含深交所可交换债券），采用交易所每日收盘价（估值全价）扣减上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券、私募债券和未上市债券，采用成本估值。

对于银行间市场上的固定收益品种，选取中国债券登记结算有限公司提供的相应品种当日的估值净价加上上一起息日至估值日每百元债券的税前应计利息（算头算尾）减去上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错更正。

7.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

2、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》：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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、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》的规定：对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。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。上市公司派发股息红利时，对个人持股 1 年以内（含 1 年）的，上市公司暂不扣缴个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|-------------------|------------------|------------------|
| | 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 31 日 |
| 活期存款 | 14,363,194.27 | 17,579,262.47 |
| 定期存款 | 600,000,000.00 | 1,200,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 50,000,000.00 | 150,000,000.00 |
| 存款期 限 1-3 个月 | 500,000,000.00 | 300,000,000.00 |
| 存款期 限 3 个月以上 | 50,000,000.00 | 750,000,000.00 |
| 其他存款 | - | - |
| 合计 | 614,363,194.27 | 1,217,579,262.47 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 | | | |
|--------|-------|------------------|------------------|--------------|---------|
| | | 2019 年 12 月 31 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 | 1,015,126,924.48 | 1,015,639,000.00 | 512,075.52 | 0.0227 |
| | 合计 | 1,015,126,924.48 | 1,015,639,000.00 | 512,075.52 | 0.0227 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 1,015,126,924.48 | 1,015,639,000.00 | 512,075.52 | 0.0227 |
| 项目 | | 上年度末 | | | |
| | | 2018 年 12 月 31 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 | 6,703,986,786.66 | 6,707,677,000.00 | 3,690,213.34 | 0.0316 |
| | 合计 | 6,703,986,786.66 | 6,707,677,000.00 | 3,690,213.34 | 0.0316 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 6,703,986,786.66 | 6,707,677,000.00 | 3,690,213.34 | 0.0316 |

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

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2019 年 12 月 31 日 | |
|--------|--------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 161,048,690.57 | - |
| 固收平台市场 | 455,200,000.00 | - |
| 合计 | 616,248,690.57 | - |
| 项目 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 2,863,806,485.80 | - |
| 固收平台市场 | 763,700,000.00 | - |
| 合计 | 3,627,506,485.80 | - |

7.4.7.4.2 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买断式逆回购交易取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,769.31 | 4,195.26 |
| 应收定期存款利息 | 666,402.76 | 3,140,986.27 |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | - | 10.18 |

| | | |
|------------|--------------|---------------|
| 应收债券利息 | 2,479,704.92 | 11,632,773.71 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | 345,260.11 | 2,402,837.87 |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 3,493,137.10 | 17,180,803.29 |

7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 47,759.14 | 110,209.59 |
| 合计 | 47,759.14 | 110,209.59 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 预提审计费 | 80,000.00 | 80,000.00 |
| 预提信息披露费 | 120,000.00 | 380,000.00 |
| 预提账户维护费 | 9,000.00 | 9,000.00 |
| 合计 | 209,000.00 | 469,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

新华壹诺宝 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 397,252,040.10 | 397,252,040.10 |
| 本期申购 | 9,390,744,833.48 | 9,390,744,833.48 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -9,328,725,722.00 | -9,328,725,722.00 |
| 本期末 | 459,271,151.58 | 459,271,151.58 |

新华壹诺宝 B

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|--------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 11,270,869,710.78 | 11,270,869,710.78 |
| 本期申购 | 16,049,748,908.14 | 16,049,748,908.14 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -25,519,745,508.98 | -25,519,745,508.98 |
| 本期末 | 1,800,873,109.94 | 1,800,873,109.94 |

注：申购含红利再投份额。

7.4.7.10 未分配利润

新华壹诺宝 A

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 | 0.00 | - |
| 本期利润 | 12,607,550.04 | - | 12,607,550.04 |
| 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 | -12,607,550.04 | - | -12,607,550.04 |
| 本期末 | - | - | - |

新华壹诺宝 B

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 |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 本期利润 | 115,484,548.60 | - | 115,484,548.60 |
| 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 | -115,484,548.60 | - | -115,484,548.60 |
| 本期末 | - | - | - |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 95,781.95 | 160,968.80 |
| 定期存款利息收入 | 25,903,930.39 | 42,958,711.48 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 434.51 | 12,915.87 |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 26,000,146.85 | 43,132,596.15 |

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期末及上年度末无股票投资。

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期末及上年度末无基金投资。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年12 月31日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31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 | 1,646,159.12 | 3,847,129.04 |
| 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 | 1,646,159.12 | 3,847,129.04 |

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年12月 31日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 24,013,861,203.03 | 55,327,512,819.59 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 23,955,459,524.01 | 55,192,159,087.50 |
| 减：应收利息总额 | 56,755,519.90 | 131,506,603.05 |
| 买卖债券差价收入 | 1,646,159.12 | 3,847,129.04 |

7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益**7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无股利收益。

7.4.7.18 公允价值变动收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无公允价值变动收益。

7.4.7.19 其他收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他收入。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 0.00 | 0.00 |
| 银行间市场交易费用 | - | 300.00 |
| 交易基金产生的费用 | - | - |
| 其中：申购费 | - | - |
| 赎回费 | - | - |
| 合计 | - | 300.00 |

7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

本报告期末，本基金未持有基金产生的费用。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 审计费用 | 80,000.00 | 80,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 380,000.00 |
| 其他 | - | 360.00 |
| 银行汇划手续费 | 97,545.81 | 122,918.35 |
| 银行间结算账户维护费 | 18,000.00 | 18,000.00 |
| 上清所结算账户维护费 | 18,000.00 | 18,000.00 |

| | | |
|----------|------------|------------|
| 上清所证书使用费 | 1,200.00 | 1,200.00 |
| 合计 | 334,745.81 | 620,478.35 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

2020 年 3 月 4 日起，本基金增加 E 类（009099）基金份额。

7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 新华信托股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 恒泰证券股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 杭州永原网络科技有限公司 | 基金管理人股东 |
| 中央汇金投资有限责任公司 | 基金托管人股东 |
| 北京新华富时资产管理有限公司 | 基金管理人的控股子公司 |
| 恒泰长财证券有限责任公司 | 基金管理人股东的全资子公司 |

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------|----|---------|
|-------|----|---------|

| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | | 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
|------------|-----------------------|----------------|-----------------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 恒泰证券股份有限公司 | 6,488,500,000.00 | 27.83% | - | - |

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 16,606,956.17 | 35,687,947.60 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,342,796.18 | 1,033,310.40 |

注：1、基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率逐日计提确认。计算公式为：每日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × (0.33% ÷ 当年天数)

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
| | | |

| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,032,410.94 | 10,814,529.64 |

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。

7.4.10.2.3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 2019年1月1日至2019年12月31日 | | |
|----------------|----------------------------------|------------|--------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 新华壹诺宝 A | 新华壹诺宝 B | 合计 |
| 恒泰证券股份有限公司 | 1,091,668.39 | 0.00 | 1,091,668.39 |
| 新华基金管理股份有限公司 | 17,358.68 | 403,597.20 | 420,955.88 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 151,251.55 | 2,048.52 | 153,300.07 |
| 合计 | 1,260,278.62 | 405,645.72 | 1,665,924.34 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 新华壹诺宝A | 新华壹诺宝B | 合计 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 211,274.37 | 4,997.30 | 216,271.67 |
| 新华基金管理股份有限公司 | 57,267.58 | 983,490.31 | 1,040,757.89 |
| 恒泰证券股份有限公司 | 899,464.61 | 0.00 | 899,464.61 |
| 合计 | 1,168,006.56 | 988,487.61 | 2,156,494.17 |

注：1、基金 A 类销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提，B 类销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01%年费率计提；

其计算公式为：A 类日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数，B 类日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%/当年天数。

2、本基金于 2016 年 10 月 24 日分为 A 类（000434），B 类（003267），并于当日对 A、B 类进行份额调整；

7.4.10.3 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 2019年1月1日至2019年12月31日 | | | | | | |
|----------------------------------|----------------|--------------------|-------|------|--------------------|-----------|
| 银行间市场 交易的各关 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 |
| 中国建设银行 股份有限公司 | - | 149,545,30 0.55 | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 | | | | | | |
| 银行间市场 交易的各关 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 |
| 中国建设银行 股份有限公司 | 244,381,753.66 | - | - | - | 646,470,000.0 0 | 78,810.78 |

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2019年1月1日至2019年12月31日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
|------------|-----------------------------|--------|----------------------------------|--------|
| | 新华壹诺宝A | 新华壹诺宝B | 新华壹诺宝A | 新华壹诺宝B |
| 期初持有的基金份额 | 0.00 | - | 0.00 | 0.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---------------------------|-----------|---|-----------|---|
| 期间因拆分变动份 额 | 50,085.88 | - | 60,900.00 | - |
| 减：期间赎回/卖出 总份额 | 50,085.88 | - | 60,900.00 | - |
| 期末持有的基金份 额 | 0.00 | - | 0.00 | - |
| 期末持有的基金份 额占基金总份额比 例 | 0.00% | - | 0.00% | - |

7.4.10.4.2 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

新华壹诺宝 B

份额单位：份

| 关联方名称 | 新华壹诺宝B本期末 2019年12月31日 | | 新华壹诺宝B上年度末 2018年12月31日 | |
|--------------------|--------------------------|--------------------------|---------------------------|--------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 |
| 北京新华富时资产 管理有限公司 | 14,235,171.63 | 0.79% | 0.00 | 0.00% |

7.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年12月31日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
|------------------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行股 份有限公司 | 14,363,194.27 | 95,781.95 | 17,579,262.47 | 160,968.80 |

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 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。

7.4.11 利润分配情况

1、新华壹诺宝 A

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 |
|------------------|-------------------|--------------|-------------------|----|
| 12,698,644.65 | - | -91,094.61 | 12,607,550.0 4 | - |

2、新华壹诺宝 B

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 |
|------------------|-------------------|---------------|--------------------|----|
| 119,070,499.31 | - | -3,585,950.71 | 115,484,548. 60 | - |

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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/增发流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截止 2019 年 12 月 31 日，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 88,064,667.9 元，于 2020 年 1 月 2 日前全部到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按银行间市场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 |
|--------|----------|------------|------------|------------|---------------|
| 130404 | 13 农发 04 | 2020-01-02 | 100.34 | 400,000.00 | 40,135,952.19 |
| 190402 | 19 农发 02 | 2020-01-02 | 99.98 | 300,000.00 | 29,994,693.43 |
| 190405 | 19 农发 05 | 2020-01-02 | 100.05 | 227,000.00 | 22,710,650.25 |
| 合计 | | | | 927,000.00 | 92,841,295.87 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。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；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 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 2019年12月31日 | 上年末 2018年12月31日 |
|--------|--------------------|--------------------|
| A-1 | - | 410,962,000.00 |
| A-1 以下 | - | - |

| | | |
|-----|---------------|------------------|
| 未评级 | 49,965,174.66 | 748,629,000.00 |
| 合计 | 49,965,174.66 | 1,159,591,000.00 |

7.4.13.2.2 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 2019年12月31日 | 上年末 2018年12月31日 |
|--------|--------------------|--------------------|
| AAA | 100,144,720.84 | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 865,017,028.98 | - |
| 合计 | 965,161,749.82 | - |

7.4.13.3 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。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。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。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2019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 | 614,363,194.27 | - | - | - | 614,363,194.27 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 1,015,126,924.48 | - | - | - | 1,015,126,924.48 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 616,248,690.57 | - | - | - | 616,248,690.57 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 3,493,137.10 | 3,493,137.10 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 100,429,699.64 | 100,429,699.64 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 2,245,738,809.32 | - | - | 103,922,836.74 | 2,349,661,646.06 |
| 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 | 88,064,667.90 | - | - | - | 88,064,667.90 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 701,449.44 | 701,449.44 |
| 应付托管费 | - | - | - | 212,560.43 | 212,560.43 |

| | | | | | |
|-----------------------------|------------------|-------|-------|------------------|-------------------|
| 应付销售服务费 | - | - | - | 117,416.97 | 117,416.97 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 47,759.14 | 47,759.14 |
| 应交税费 | - | - | - | 743.93 | 743.93 |
| 应付利息 | - | - | - | 8,224.60 | 8,224.60 |
| 应付利润 | - | - | - | 155,562.13 | 155,562.13 |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 209,000.00 | 209,000.00 |
| 负债总计 | 88,064,667.90 | - | - | 1,452,716.64 | 89,517,384.54 |
| 利率敏感度缺口 | 2,157,674,141.42 | - | - | 102,470,120.10 | 2,260,144,261.52 |
| 上年度末 2018 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 | 1,217,579,262.47 | - | - | - | 1,217,579,262.47 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 6,703,986,786.66 | - | - | - | 6,703,986,786.66 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | 3,627,506,485.80 | 3,627,506,485.80 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 17,180,803.29 | 17,180,803.29 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 109,905,310.31 | 109,905,310.31 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 7,921,566,049.13 | - | - | 3,754,592,599.40 | 11,676,158,648.53 |
| 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 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---------|------------------|---|---|------------------|-------------------|
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,589,027.00 | 2,589,027.00 |
| 应付托管费 | - | - | - | 784,553.64 | 784,553.64 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 171,569.45 | 171,569.45 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 110,209.59 | 110,209.59 |
| 应交税费 | - | - | - | 79,930.52 | 79,930.52 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | 3,832,607.45 | 3,832,607.45 |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 469,000.00 | 469,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 8,036,897.65 | 8,036,897.65 |
| 利率敏感度缺口 | 7,921,566,049.13 | - | - | 3,746,555,701.75 | 11,668,121,750.88 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 其他市场变量不变，市场利率上升或下降 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：人民币元） | |
| | | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
| | 市场利率上升 25.00 bp | 减少约 514,025.74 | 减少约 2,959,177.72 |
| | 市场利率下降 25.00 bp | 增加约 514,735.19 | 增加约 2,966,584.92 |

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，不投资股票、权证等其他交易性

金融资产。因此无重大其他价格风险。

§8 投资组合报告

8.1 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 | 1,015,126,924.48 | 43.20 |
| | 其中：债券 | 1,015,126,924.48 | 43.20 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 616,248,690.57 | 26.23 |
| | 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 | 614,363,194.27 | 26.15 |
| 4 | 其他各项资产 | 103,922,836.74 | 4.42 |
| 5 | 合计 | 2,349,661,646.06 | 100.00 |

8.2 债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例 (%) | |
|----|--------------|---------------|----------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 1.99 | |
| | 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 | 88,064,667.90 | 3.90 |
| | 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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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 | 54 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 58 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 6 |

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。

8.3.2 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 | 33.65 | 3.90 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 15.42 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 46.80 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | - | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 3.50 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.36 | 3.90 |

8.4 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。

8.5 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 | 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 | 100,144,720.84 | 4.43 |
| | 其中：政策性金融债 | 100,144,720.84 | 4.43 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 49,965,174.66 | 2.21 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 865,017,028.98 | 38.27 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,015,126,924.48 | 44.91 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

8.6 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 | 111915063 | 19 民生银行 CD063 | 1,000,000.00 | 99,591,213.83 | 4.41 |
| 2 | 111906065 | 19 交通银行 CD065 | 1,000,000.00 | 99,515,165.26 | 4.40 |
| 3 | 011902161 | 19 电网 SCP006 | 500,000.00 | 49,965,174.66 | 2.21 |
| 4 | 111916318 | 19 上海银行 CD318 | 500,000.00 | 49,911,449.95 | 2.21 |
| 5 | 111911028 | 19 平安银行 CD028 | 500,000.00 | 49,823,632.40 | 2.20 |
| 6 | 111912013 | 19 北京银行 CD013 | 500,000.00 | 49,823,125.82 | 2.20 |
| 7 | 111910065 | 19 兴业银行 CD065 | 500,000.00 | 49,811,459.20 | 2.20 |
| 8 | 111911267 | 19 平安银行 CD267 | 500,000.00 | 49,706,510.47 | 2.20 |
| 9 | 111976070 | 19 宁波银行 CD269 | 500,000.00 | 49,703,659.26 | 2.20 |
| 10 | 111993002 | 19 杭州银行 CD036 | 500,000.00 | 49,702,954.83 | 2.20 |

8.7“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 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1221% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0068% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0225% |

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。

8.8 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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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 | 3,493,137.10 |
| 4 | 应收申购款 | 100,429,699.64 |

| | | |
|---|-------|----------------|
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 103,922,836.74 |

8.9.4 其他需说明的重要事项标题

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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 |
| 新华壹诺宝 A | 69,616 | 6,597.21 | 3,101,833.24 | 0.68% | 456,169,318.34 | 99.32% |
| 新华壹诺宝 B | 17 | 105,933,712.35 | 1,800,873,109.94 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 69,633 | 32,457.95 | 1,803,974,943.18 | 79.82% | 456,169,318.34 | 20.18% |

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额(份) | 占总份额比例 |
|----|-------|----------------|--------|
| 1 | 银行类机构 | 583,139,543.16 | 27.19% |
| 2 | 其他机构 | 378,125,726.81 | 17.63% |
| 3 | 保险类产品 | 247,210,382.64 | 11.53% |
| 4 | 银行类机构 | 200,028,138.24 | 9.33% |
| 5 | 保险类产品 | 102,287,019.20 | 4.77% |
| 6 | 保险类产品 | 80,582,733.32 | 3.76% |
| 7 | 其他机构 | 50,251,650.40 | 2.34% |
| 8 | 保险类产品 | 31,981,985.96 | 1.49% |

| | | | |
|----|-------|---------------|-------|
| 9 | 券商类产品 | 30,043,749.43 | 1.40% |
| 10 | 其他机构 | 23,786,844.55 | 1.11% |

9.3 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 | 新华壹诺宝 A | 31,326.48 | 0.01% |
| | 新华壹诺宝 B | 0.00 | 0.00% |
| | 合计 | 31,326.48 | 0.00% |

注：本公司所有从业人员持有本基金份额总量为 31326.48 份。

9.4 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 | 新华壹诺宝 A | 0~10 |
| | 新华壹诺宝 B | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 新华壹诺宝 A | 0 |
| | 新华壹诺宝 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0~10 万份；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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 新华壹诺宝 A | 新华壹诺宝 B |
|------------------------------------|------------------|-------------------|
| 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 | 397,252,040.10 | 11,270,869,710.78 |
| 本报告期基金总申购份额 | 9,390,744,833.48 | 16,049,748,908.14 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 9,328,725,722.00 | 25,519,745,508.98 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 459,271,151.58 | 1,800,873,109.94 |

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2019 年 4 月 18 日，陈重先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司董事长。

2019 年 4 月 18 日，张宗友先生离任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司总经理，新任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司董事长，代任总经理。

2019 年 6 月 6 日，刘全胜先生新任本基金基金管理人新华基金管理股份有限公司总经理。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所情况。报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。审计年限为 1 年。自 2013 年至 2019 年，瑞华会计师事务所为本基金连续提供 7 年审计服务。

11.7 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，本基金无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-------|---|---|---|---|---|---|
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 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 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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，本基金共租用 15 个交易席位，其中报告期内新增 0 个交易席位，退租 0 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。

11.8.2 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 | - | - | 2,397,400,000.00 | 10.28% | - | - |
| 申银万国 | - | - | 7,416,102,000.00 | 31.80% | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | 624,400,000.00 | 2.68% | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | 6,488,500,000.00 | 27.83% | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | 2,098,500,000.00 | 9.00% | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | 2,723,200,000.00 | 11.68% | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | 1,569,600,000.00 | 6.73% | - | - |

11.9 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。

11.10 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 | 新华壹诺宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站 | 2019-01-16 |

| | | | |
|----|---|----------------------------|------------|
| 2 | 新华壹诺宝货币市场基金招募说明书（更新） | 公司网站 | 2019-01-16 |
| 3 | 新华壹诺宝货币市场基金 2018 年第 4 季度报告 | 证券时报、公司网站 | 2019-01-22 |
| 4 | 新华基金管理股份有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站 | 2019-01-26 |
| 5 | 新华基金管理股份有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站 | 2019-01-29 |
| 6 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的信威集团估值方法调整的公告 | 证券日报、公司网站 | 2019-02-14 |
| 7 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加众升财富（北京）基金销售有限公司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 | 2019-02-26 |
| 8 | 新华壹诺宝货币市场基金 2018 年年度报告（摘要） | 证券时报、公司网站 | 2019-03-28 |
| 9 | 新华壹诺宝货币市场基金 2018 年年度报告 | 公司网站 | 2019-03-28 |
| 10 | 新华壹诺宝货币市场基金 2019 年第 1 季度报告 | 证券时报、公司网站 | 2019-04-18 |
| 11 | 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 | 证券时报、公司网站 | 2019-04-20 |
| 12 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司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 | 2019-05-08 |
| 13 | 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 | 证券时报、公司网站 | 2019-06-11 |
| 14 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2019 年半年度最后一日交易日资产净值的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站 | 2019-06-29 |
| 15 | 新华基金管理股份有限公司关于公司法定代表人变更的公告 | 中国证券报、公司网站 | 2019-07-04 |
| 16 | 新华基金管理股份有限公司关于取消浙江金观诚基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站 | 2019-07-08 |
| 17 | 新华壹诺宝货币市场基金招募说明书（更新） | 公司网站 | 2019-07-17 |
| 18 | 新华壹诺宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要 | 证券时报、公司网站 | 2019-07-17 |
| 19 | 新华壹诺宝货币市场基金 2019 年第 2 季度报告 | 证券时报、公司网站 | 2019-07-19 |
| 20 | 新华壹诺宝货币市场基金 2019 年半年度报告（摘要） | 证券时报、公司网站 | 2019-08-24 |
| 21 | 新华壹诺宝货币市场基金 2019 年半年度报告 | 公司网站 | 2019-08-24 |
| 22 | 新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加中信建投证券股份有限公司为销售机构的 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、 | 2019-09-20 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------------|------------|
| | 公告 | 公司网站、电子信披网站 | |
| 23 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海好买基金销售有限公司调整定期定额投资业务起点金额的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2019-09-25 |
| 24 | 新华壹诺宝货币市场基金 2019 年第 3 季度报告 | 公司网站、电子信披网站 | 2019-10-24 |
| 25 | 新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2019-10-24 |
| 26 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、基金转换业务及参加费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2019-10-26 |
| 27 | 新华基金管理股份有限公司旗下部分基金增加中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司为销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2019-11-22 |
| 28 | 新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在奕丰基金销售有限公司调整基金最低申购金额、定投起点的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2019-11-26 |
| 29 | 新华基金管理股份有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 43 只基金基金合同和托管协议的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站 | 2019-12-13 |
| 30 | 新华壹诺宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要 | 公司网站 | 2019-12-13 |
| 31 | 新华壹诺宝货币市场基金招募说明书（更新）全文 | 公司网站 | 2019-12-13 |

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 | 20190617-20191231 | 1,062,368,752.66 | 20,770,790.50 | 500,000,000.00 | 583,139,543.16 | 25.80% |
| | 2 | 20190725-20191105, 20191203 | 533,872,642.46 | 13,337,740.18 | 300,000,000.00 | 247,210,382.64 | 10.94% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可 | | | | | | | |

能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；

2、基金净值大幅波动的风险

机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；

3、提前终止基金合同的风险

机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；

4、基金规模过小导致的风险

机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 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基金合同
- (四)新华壹诺宝货币市场基金托管协议
- (五)新华壹诺宝货币市场基金登记结算服务协议
- (六)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (七)更新的《新华壹诺宝货币市场基金招募说明书》
- (八)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程
- (九)基金托管人业务资格批件和营业执照
- (十)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
- (十一)中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 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

二〇二〇年三月二十六日