

新华壹诺宝货币市场基金

2021 年中期报告

2021 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：二〇二一年八月二十七日

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。本中期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 2021 年 8 月 26 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 2021 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
1.2 目录	3
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.....	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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.....	11
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	11
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表 14	
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	56
7.1 期末基金资产组合情况.....	56
7.2 债券回购融资情况.....	58
7.3 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.4 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细	62
7.5“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62
7.7 投资组合报告附注.....	63
8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末上市基金前十名持有人	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	66
9 开放式基金份额变动	68

10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	70
10.9 其他重大事件.....	70
11 影响投资者决策的其他重要信息	70
12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

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	7,759,148,090.07 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	新华壹诺宝 E
下属分级基金的交易代码	000434	003267	009099
报告期末下属分级基金的份额总额	433,243,150.35 份	7,325,904,938.72 份	1.00 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	李申
	联系电话	010-68779688	021-60637102
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008198866	021-60637111
传真		010-68779528	021-60635778
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，北京市海淀区西三环北路11号海通时代商务中心C1座	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	翟晨曦	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	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（2021年1月1日至2021年6月30日）		
	新华壹诺宝 A	新华壹诺宝 B	新华壹诺宝 E
本期已实现收益	4,667,948.59	78,897,470.06	0.00
本期利润	4,667,948.59	78,897,470.06	0.00
本期净值收益率	0.9507%	1.0710%	0.0000%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)		
	新华壹诺宝 A	新华壹诺宝 B	新华壹诺宝 E
期末基金资产净值	433,243,150.35	7,325,904,938.72	1.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)		
	新华壹诺宝 A	新华壹诺宝 B	新华壹诺宝 E
累计净值收益率	25.0933%	14.9337%	0.0000%

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，于2016年10月24日分为A类（基金代码：000434）、

B 类（基金代码：003267），2020 年 3 月 4 日起增加 E 类（基金代码：009099），2021 年 3 月 11 日起有 E 类份额。

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
过去一个月	0.1466%	0.0009%	0.1110%	0.0000%	0.0356%	0.0009%
过去三个月	0.4467%	0.0006%	0.3371%	0.0000%	0.1096%	0.0006%
过去六个月	0.9507%	0.0007%	0.6717%	0.0000%	0.2790%	0.0007%
过去一年	1.9494%	0.0008%	1.3572%	0.0000%	0.5922%	0.0008%
过去三年	6.7749%	0.0022%	4.1331%	0.0000%	2.6418%	0.0022%
自基金成立起至 今	25.0933%	0.0049%	10.7677%	0.0000%	14.3256%	0.0049%

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
过去一个月	0.1664%	0.0009%	0.1110%	0.0000%	0.0554%	0.0009%
过去三个月	0.5070%	0.0006%	0.3371%	0.0000%	0.1699%	0.0006%
过去六个月	1.0710%	0.0007%	0.6717%	0.0000%	0.3993%	0.0007%
过去一年	2.1943%	0.0008%	1.3572%	0.0000%	0.8371%	0.0008%
过去三年	7.5466%	0.0022%	4.1331%	0.0000%	3.4135%	0.0022%
自基金成立起至 今	14.9337%	0.0032%	6.5281%	0.0000%	8.4056%	0.0032%

3. 新华壹诺宝 E:

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	0.0000%	0.0000%	0.1110%	0.0000%	-0.1110%	0.0000%
过去三个月	0.0000%	0.0000%	0.3371%	0.0000%	-0.3371%	0.0000%
过去六个月	0.0000%	0.0000%	0.4151%	0.0000%	-0.4151%	0.0000%
自基金成立起至 今	0.0000%	0.0000%	0.4151%	0.0000%	-0.4151%	0.0000%

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），

2020 年 3 月 4 日起增加 E 类（基金代码：009099），2021 年 3 月 11 日起有 E 类份额。

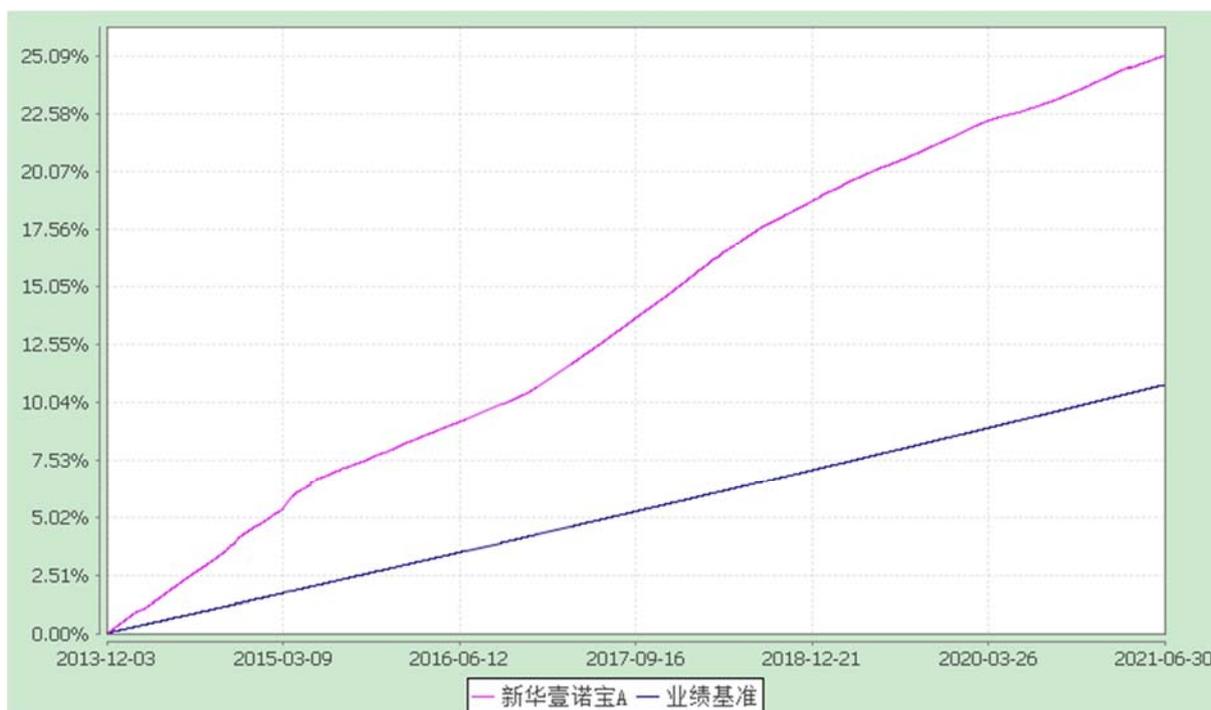
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华壹诺宝货币市场基金

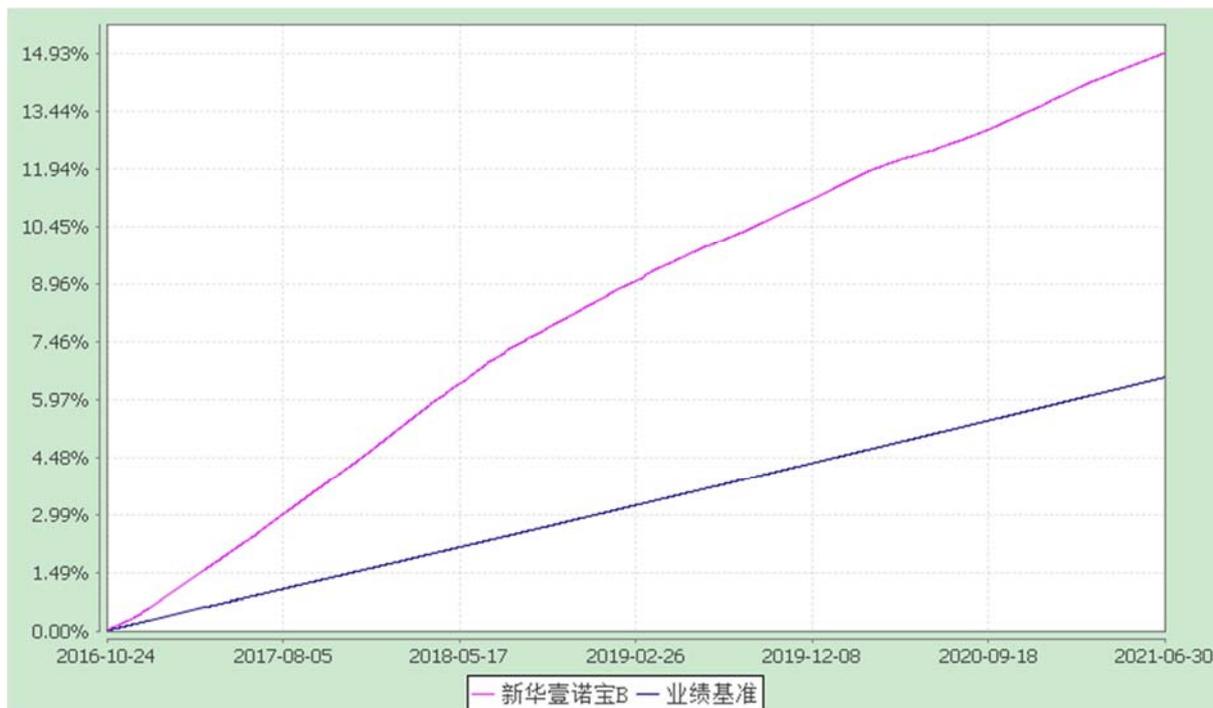
自基金合同生效以来份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 12 月 3 日至 2021 年 6 月 30 日)

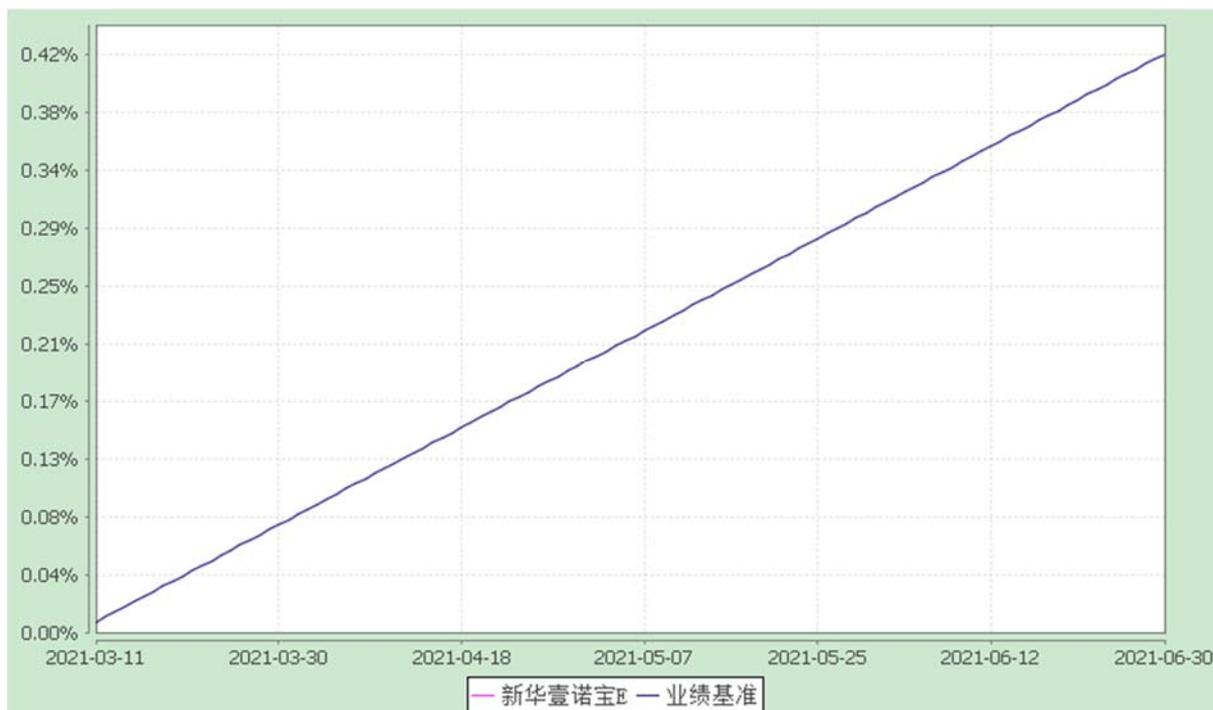
新华壹诺宝 A



新华壹诺宝 B



新华壹诺宝 E



注：1、本基金于 2013 年 12 月 3 日成立，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），2020 年 3 月 4 日起增加 E 类（基金代码：009099），2021 年 3 月 11 日起有 E 类份额。

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 2021 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十二只开放式基金，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、新华恒稳添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、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、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有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		
王滨	本基金基金经理，固定收益投资部总监、新华活期添利货币市场基金基金经理、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、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华增强债券型证券投资基金基金经理、新华安享惠融 88 个月定期开放	2017-07-13	2021-05-19	14	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。

	债券型证券投资基金基金经理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理。				
李洁	本基金基金经理，新华活期添利货币市场基金经理、新华增强债券型证券投资基金基金经理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2020-07-13	-	7	经济学硕士，历任中债信用业务经理、高级经理，新华基金固定收益与平衡投资部债券研究员、基金经理助理。
张乃先	本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、安享惠金定期开放债券型证券	2020-06-03	-	6	经济学硕士，历任新华基金固定收益信用研究员、宏观研究员、高级宏观研究员。

	债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理。				
于航	本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、安享惠金定	2020-06-03	-	6	统计学硕士，历任新华基金股票交易员，固定收益与平衡投资部研究员，从事宏观研究、策略研究、信用研究、转债研究等多个方向研究工作。

	<p>期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、</p>				
--	---	--	--	--	--

	新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理。				
李晓然	本基金基金经理助理，新华安享惠金定期开放债券型证	2021-03-01	-	8	金融与投资硕士，历任大公国际资信评估有限公司分析师、行业组长、经理，新华基金固定收益信用研究员。

	<p>券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华增强债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金</p>				
--	---	--	--	--	--

	金经理助理、新华丰盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华双利债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理。				
--	---	--	--	--	--

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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

上半年，宏观经济延续复苏态势但动能在二季度有所趋缓，PMI 保持在扩张区间，工业生产维持高位，制造业景气持续改善，出口高于预期。货币政策强调保持货币供应量与名义经济增速相匹配，在保持经济平稳增长和防控风险中取得平衡，整体维持稳定连续，资金较为宽松。利率债一季度整体呈现窄幅震荡，对各项基本面数据的反应相对钝化，受美债收益率的影响有所波动；二季度利率债在经济复苏动能趋弱、资金宽松、地方债发行滞后等因素影响下呈现小幅下行。整体来看，上半年 1 年期国开债收益率较年初下行 7BP 至 2.51%，10 年期国开债收益率较一季度末下行 9BP 至 3.49%。信用债方面，年初以来受信用风险事件、发行政策收紧、到期量大等影响，信用债净融资大幅转负，瑕疵企业融资情况未改善；另一方面，在资金宽松和配置需求的背景下，信用债收益率整

体呈现震荡下行，但内部分化严重，市场仍然保持谨慎应对。

报告期内，本基金继续以机构持有人为主，基金规模小幅下降，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，保障组合流动性充足，同时根据规模及配置时点合理调整各类资产配置比例，在提供充分流动性保证的情况下为持有人获取了较好的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内 A 类（000434）基金份额净值收益率为 0.9507%，同期业绩比较基准收益率为 0.6717%，B 类（003267）基金份额净值收益率为 1.0710%，同期业绩比较基准收益率为 0.6717%，；E 类（009099）基金份额净值收益率为 0.0000%，同期业绩比较基准收益率为 0.4151%，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），2020 年 3 月 4 日起增加 E 类（基金代码：009099），2021 年 3 月 11 日起有 E 类份额。

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 2021 年下半年，经济将延续弱复苏态势，货币政策在稳定经济和防风险的背景下保持稳健中性的概率较大。全球经济修复、通胀、美联储政策转向预期以及资金面和供给因素的扰动对债券市场仍构成压力，中期经济增速下行对配置盘形成支撑，叠加机构方面普遍的偏短久期和偏低杠杆行为，收益率上行空间有限，长债或继续维持震荡格局。操作方面，窄幅波动区间内，久期策略交易机会不易把握，杠杆策略需警惕资金面的波动，票息策略更为稳妥但需要警惕打破刚兑进程中的信用风险。

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、投资管理部门、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门相互独立。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、投资管理部门的职责分工

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。

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管理部门问讯；
- 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 83,565,418.65 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 4,667,948.59 元，B 类份额实施利润分配的金额为 78,897,470.06 元，E 类份额实施利润分配的金额为 0.00 元。

5.3 托管人对本中期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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,110,733,882.43	922,383,617.58
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,510,637,259.89	5,781,884,991.13
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,507,359,259.89	5,761,884,991.13
资产支持证券投资		3,278,000.00	20,000,000.00
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,120,423,130.13	3,789,315,610.65
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	5,310,255.16	20,759,175.30
应收股利		-	-
应收申购款		230,005,260.03	231,736,221.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,977,109,787.64	10,746,079,615.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		194,399,702.80	-
应付证券清算款		19,890,252.17	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,056,698.12	1,671,992.76

应付托管费		623,241.86	506,664.47
应付销售服务费		156,341.78	148,662.20
应付交易费用	6.4.7.7	142,438.63	104,106.10
应交税费		45,211.49	24,973.40
应付利息		19,258.92	-
应付利润		520,372.85	726,708.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,178.95	209,000.00
负债合计		217,961,697.57	3,392,107.18
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	7,759,148,090.07	10,742,687,508.81
未分配利润	6.4.7.10	0.00	0.00
所有者权益合计		7,759,148,090.07	10,742,687,508.81
负债和所有者权益总计		7,977,109,787.64	10,746,079,615.99

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类(000434)基金份额净值 1.000 元，基金份额 433,243,150.35 份；B 类（003267）基金份额净值 1.000 元基金份额 7,325,904,938.72 份；E 类（009099）基金份额净值 1.000 元，基金份额 1.00 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		101,926,605.90	51,119,540.69
1.利息收入		101,720,486.94	50,996,095.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21,945,012.13	18,479,640.35
债券利息收入		50,075,826.50	16,511,535.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		29,699,648.31	16,004,919.38
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		206,118.96	123,445.43
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	206,118.96	123,445.43
资产支持证券投资收益		0.00	-
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		18,361,187.25	10,662,092.90
1. 管理人报酬		12,979,647.95	7,088,617.04
2. 托管费		3,933,226.51	2,148,065.74
3. 销售服务费		981,949.62	848,762.67
4. 交易费用		125.00	-
5. 利息支出		258,973.33	379,775.24
其中：卖出回购金融资产支出		258,973.33	379,775.24
6.税金及附加		23,696.26	19,876.66
7. 其他费用	6.4.7.14	183,568.58	176,995.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		83,565,418.65	40,457,447.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		83,565,418.65	40,457,447.79

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	10,742,687,508.81	-	10,742,687,508.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	83,565,418.65	83,565,418.65
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）	-2,983,539,418.74	-	-2,983,539,418.74
其中：1.基金申购款	29,301,236,440.53	-	29,301,236,440.53
2.基金赎回款	-32,284,775,859.27	-	-32,284,775,859.27
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）	-	-83,565,418.65	-83,565,418.65
五、期末所有者权益（基金净值）	7,759,148,090.07	-	7,759,148,090.07
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	2,260,144,261.52	-	2,260,144,261.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,457,447.79	40,457,447.79
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）	3,187,764,278.73	-	3,187,764,278.73
其中：1.基金申购款	15,651,228,039.01	-	15,651,228,039.01
2.基金赎回款	-12,463,463,760.28	-	-12,463,463,760.28
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）	-	-40,457,447.79	-40,457,447.79
五、期末所有者权益（基金净值）	5,447,908,540.25	-	5,447,908,540.25

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：翟晨曦，主管会计工作负责人：于春玲，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2021年8月26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

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）交易印花税征收方式，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、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》的规定：2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 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[2016]140 号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2 号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56 号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90 号）的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，证券投资基金在运营过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照现行规定缴纳增值税及附加税费。

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。

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 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	20,733,882.43
定期存款	1,090,000,000.00
存款期限 1-3 个月	940,000,000.00
存款期限 3 个月以上	150,000,000.00
其他存款	-
合计	1,110,733,882.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 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	5,507,359,25 9.89	5,507,370,000. 00	10,740.11	0.0001
	合计	5,507,359,25 9.89	5,507,370,000. 00	10,740.11	0.0001
资产支持证券		3,278,000.00	3,284,000.00	6,000.00	0.0001
合计		5,510,637,25 9.89	5,510,654,000. 00	16,740.11	0.0002

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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	833,423,130.13	-
固收平台市场	287,000,000.00	-
合计	1,120,423,130.13	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	738.30
应收定期存款利息	1,378,138.83
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	3,525,931.65
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	405,446.38
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	5,310,255.16

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	142,438.63
合计	142,438.63

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提审计费	39,671.58
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,000.00
合计	108,178.95

6.4.7.8 实收基金

新华壹诺宝 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	475,998,647.16	475,998,647.16
本期申购	4,829,391,434.58	4,829,391,434.58
本期赎回（以“-”号填列）	-4,872,146,931.39	-4,872,146,931.39
本期末	433,243,150.35	433,243,150.35

新华壹诺宝 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,266,688,861.65	10,266,688,861.65
本期申购	24,471,845,004.95	24,471,845,004.95
本期赎回（以“-”号填列）	-27,412,628,927.88	-27,412,628,927.88
本期末	7,325,904,938.72	7,325,904,938.72

新华壹诺宝 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	1.00	1.00
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1.00	1.00

注：1.申购含红利再投，转换入份额，赎回含转换出份额。

2.2021年3月11日起有E类份额。

6.4.7.9 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	0.00
本期利润	4,667,948.59	-	4,667,948.59
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	-4,667,948.59	-	-4,667,948.59
本期末	0.00	0.00	0.00

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
上年度末	0.00	-	0.00
本期利润	78,897,470.06	-	78,897,470.06
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	-78,897,470.06	-	-78,897,470.06
本期末	0.00	-	0.00

新华壹诺宝 E

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	0.00	-	0.00
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	-	-	-
本期末	0.00	-	0.00

注：2021 年 3 月 11 日起有 E 类份额

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,712.04
定期存款利息收入	21,917,300.09
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	0.00

其他	-
合计	21,945,012.13

6.4.7.11 股票投资收益

本报告期，本基金无股票投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,423,076,419.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,371,039,923.09
减：应收利息总额	51,830,376.98
买卖债券差价收入	206,118.96

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	16,838,204.41
减：卖出资产支持证券成本总额	16,722,000.00
减：应收利息总额	116,204.41
资产支持证券投资收益	0.00

6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期，本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本报告期，本基金无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本报告期，本基金无公允价值变动收益。

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021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	125.00
合计	125.00

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	66,209.63
指数使用费	0.00
银行间账户维护费	18,180.00
合计	183,568.58

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 2021 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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	-	-	911,000,000.00	13.67%

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,979,647.95	7,088,617.04
其中：支付销售机构的客户维护费	1,171,687.32	763,108.96

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,933,226.51	2,148,065.74

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			
	2021年1月1日至2021年6月30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	新华壹诺宝 E	合计
中国建设银行股份有限公司	40,500.06	264.66	-	40,764.72
恒泰证券股份有限公司	514,519.92	-	-	514,519.92
新华基金管理股份有限公司	26,727.40	281,650.04	-	308,377.44
合计	581,747.38	281,914.70	-	863,662.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2020年1月1日至2020年6月30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	新华壹诺宝 E	合计
新华基金管理股份有限公司	7,103.71	158,486.35	-	165,590.06
恒泰证券股份有限公司	568,946.10	-	-	568,946.10
中国建设银行股份有限公司	53,898.02	72.96	-	53,970.98
合计	629,947.83	158,559.31	-	788,507.14

注：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，E 类销售服务费按前一日基金资产净值的 0.05% 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，E 类日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.3 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.3.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

报告期内无转融通出借业务。

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 2021年1月1日至2021年6月30日			上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	新华壹诺宝A	新华壹诺宝B	新华壹诺宝E	新华壹诺宝A	新华壹诺宝B	新华壹诺宝E
基金合同生效日（2013年12月3日）持有的基金份额	-	-	-	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-	0.00	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-	-	-

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

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

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 2021年6月30日		新华壹诺宝B上年度末 2020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	90,074,663.80	1.23%	88,228,957.93	0.86%
恒泰证券股份有限公司	942,965,788.73	12.87%	200,085,721.44	1.95%

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国建设银行股份有限公司	20,733,882.43	27,712.04	10,576,088.27	40,220.21

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**6.4.10.7.1 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。

6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本报告期，本基金未产生交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.11 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
4,671,034.77	-	-3,086.18	4,667,948.59	-

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
79,100,719.28	-	-203,249.22	78,897,470.06	-

6.4.12 期末（2021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

截止 2021 年 6 月 30 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 194,399,702.80 元，于 2021 年 7 月 1 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
2103679	21 进出 679	2021-07-01	99.60	500,000.00	49,798,991.40
219928	21 贴现国债 28	2021-07-01	99.56	1,100,000.00	109,520,078.78
200010	20 付息国债 10	2021-07-01	100.01	400,000.00	40,002,020.71
合计				2,000,000.00	199,321,090.89

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金未参与转融通证券出借业务。

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。

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 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	50,000,010.10	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	538,872,293.18	990,827,839.61
合计	588,872,303.28	990,827,839.61

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	4,918,486,956.61	4,771,057,151.52
合计	4,918,486,956.61	4,771,057,151.52

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	3,278,000.00	20,000,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	3,278,000.00	20,000,000.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,110,733,882.43	-	-	-	1,110,733,882.43
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融	5,510,637,259.89	-	-	-	5,510,637,259.89

资产					
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,120,423,130.13	-	-	-	1,120,423,130.13
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	5,310,255.16	5,310,255.16
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	230,005,260.03	230,005,260.03
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,741,794,272.45	-	-	235,315,515.19	7,977,109,787.64
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	194,399,702.80	-	-	-	194,399,702.80
应付证券清算款	-	-	-	19,890,252.17	19,890,252.17
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,056,698.12	2,056,698.12
应付托管费	-	-	-	623,241.86	623,241.86
应付销售服务费	-	-	-	156,341.78	156,341.78
应付交易费用	-	-	-	142,438.63	142,438.63
应交税费	-	-	-	45,211.49	45,211.49
应付利息	-	-	-	19,258.92	19,258.92
应付利润	-	-	-	520,372.85	520,372.85
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	108,178.95	108,178.95
负债总计	194,399,702.80	-	-	23,561,994.77	217,961,697.57
利率敏感度缺口	7,547,394,569.65	-	-	211,753,520.42	7,759,148,090.07
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	922,383,617.58	-	-	-	922,383,617.58
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融 资产	5,781,884,991.13	-	-	-	5,781,884,991.13
衍生金融资 产	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	3,789,315,610.65	-	-	-	3,789,315,610.65
应收证券清 算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	20,759,175.30	20,759,175.30
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	231,736,221.33	231,736,221.33
递延所得税 资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,493,584,219.3 6	-	-	252,495,396.63	10,746,079,615.9 9
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	-	-	-	1,671,992.76	1,671,992.76
应付托管费	-	-	-	506,664.47	506,664.47
应付销售服 务费	-	-	-	148,662.20	148,662.20
应付交易费 用	-	-	-	104,106.10	104,106.10
应交税费	-	-	-	24,973.40	24,973.40
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	726,708.25	726,708.25

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	209,000.00	209,000.00
负债总计	-	-	-	3,392,107.18	3,392,107.18
利率敏感度缺口	10,493,584,219.36	-	-	249,103,289.45	10,742,687,508.81

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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	上年度末
		2021年6月30日	2020年12月31日
	市场利率上升 25.00 bp	-2,282,085.00	-1,849,200.04
	市场利率下降 25.00 bp	2,284,385.07	1,850,787.02

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。

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	5,510,637,259.89	69.08
	其中：债券	5,507,359,259.89	69.04
	资产支持证券	3,278,000.00	0.04

2	买入返售金融资产	1,120,423,130.13	14.05
	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	1,110,733,882.43	13.92
4	其他各项资产	235,315,515.19	2.95
5	合计	7,977,109,787.64	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	194,399,702.80	2.51
	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	55
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	18

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	26.20	2.76
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
2	30 天（含）—60 天	26.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	35.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	1.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	99.78	2.76

7.4 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 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	249,175,052.04	3.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	139,754,898.40	1.80
	其中：政策性金融债	139,754,898.40	1.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	199,942,352.84	2.58
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,918,486,956.61	63.39
8	其他	-	-
9	合计	5,507,359,259.89	70.98
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	112084674	20 南京银行 CD099	1,500,000.00	149,616,841.30	1.93
2	112119093	21 恒丰银行 CD093	1,500,000.00	149,064,396.05	1.92
3	219928	21 贴现国债 28	1,100,000.00	109,520,078.78	1.41
4	012102279	21 大唐集 SCP004	1,000,000.00	99,945,955.66	1.29
5	112089793	20 南京银行 CD138	1,000,000.00	99,867,379.35	1.29
6	112182879	21 深圳农商银行 CD012	1,000,000.00	99,852,619.43	1.29
7	112191073	21 重庆农村商行 CD014	1,000,000.00	99,845,273.63	1.29
8	112198491	21 宁波银行 CD095	1,000,000.00	99,843,920.70	1.29
9	112115127	21 民生银行 CD127	1,000,000.00	99,819,237.97	1.29
10	112010288	20 兴业银行 CD288	1,000,000.00	99,808,458.84	1.29

7.7“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	0.0654%
报告期内偏离度的最低值	-0.0289%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0156%

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。

7.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	2089525	20 海盈 1A_BC	200,000.00	3,278,000.00	0.04

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 (1) “20 南京银行 CD099”、“20 南京银行 CD138”发行人南京银行股份有限公司因未履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录等行为，人民银行南京分行对该行处以 736 万元罚款，没收违法所得 208778.02 元。（（南银）罚字（2020）30 号，2020 年 12 月 28

(2) “21 深圳农商银行 CD012”发行人深圳农村商业银行因个人消费贷款未严格执行受托支付，被深圳银保监局罚款 40 万元。（深银保监罚决字（2020）35 号，2021 年 5 月 14 日）

(3) “21 宁波银行 CD095”发行人宁波银行股份有限公司，因代理销售保险不规范等行为，宁波证监局对该行罚款 25 万元。（甬银保监罚决字（2021）36 号，2021 年 6 月 10 日）

(4) “21 民生银行 CD127”发行中国民生银行股份有限公司因违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资、为“四证”不全的房地产项目提供融资、违规为土地储备中心提供融资等原因，中国银行保险监督管理委员会对公司处以没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 万元。（银保监罚决字（2020）43 号，2020 年 7 月 14 日）

(5) “21 重庆农村商行 CD014”发行人重庆农村商业银行股份有限公司，因未严格监控贷款资金流向致部分贷款被土储机构使用等 5 项违法违规行为，重庆银保监局对该行罚款人民币 180 万元。（渝银保监罚决字（2020）42 号，2020 年 9 月 2 日）

另，因通过信托计划回购实现不良资产虚假转让出表、信贷资产风险分类不准确、贷款资金被挪用的违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条（五）项规定，严重违

反审慎经营规则，重庆银保监局对该机构罚款 90 万元。（渝银保监罚决字〔2020〕42 号，2020 年 8 月 4 日）

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金投资的其他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。

7.9.3 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	5,310,255.16
4	应收申购款	230,005,260.03
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	235,315,515.19

7.9.4 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

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	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
新华壹诺宝 A	72,104	6,008.59	62,374,157.96	14.40%	370,868,992.39	85.60%
新华壹诺宝 B	79	92,732,973.91	7,325,904,938.72	100.00%	0.00	0.00%
新华壹诺宝 E	1	1.00	0.00	0.00%	1.00	100.00%
合计	72,184	107,491.25	7,388,279,096.68	95.22%	370,868,993.39	4.78%

8.2 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	其他机构	929,246,924.06	11.98%
2	券商类机构	742,965,788.73	9.58%
3	银行类机构	504,638,355.15	6.50%
4	银行类机构	500,000,000.00	6.44%
5	保险类产品	400,012,011.85	5.16%
6	银行类机构	300,018,017.77	3.87%
7	银行类机构	300,006,005.92	3.87%
8	银行类机构	300,000,000.00	3.87%
9	银行类机构	203,287,490.18	2.62%
10	券商类机构	202,172,957.69	2.61%

8.3 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	55,140.18	0.01%
	新华壹诺宝 B	0.00	0.00%
	新华壹诺宝 E	0.00	0.00%
	合计	55,140.18	0.00%

8.4 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
	新华壹诺宝 E	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
	新华壹诺宝 E	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

项目	新华壹诺宝 A	新华壹诺宝 B	新华壹诺宝 E
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	475,998,647.16	10,266,688,861.65	-
本报告期基金总申购份额	4,829,391,434.58	24,471,845,004.95	1.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,872,146,931.39	27,412,628,927.88	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	433,243,150.35	7,325,904,938.72	1.00

注：2020 年 3 月 4 日起增加 E 类（基金代码：009099），2021 年 3 月 11 日起有 E 类份额。

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

2021 年 4 月 9 日，翟晨曦女士担任本基金基金管理人董事长职务，张宗友先生担任本基金基金管理人联席董事长职务。

2021 年 5 月 26 日，于春玲女士担任本基金基金管理人总经理职务。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 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。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为进一步维护基金持有人利益，促进会计师事务所提供更优质的服务，2021 年 2 月 1 日本基金

会计师事务所由瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）变更为致同会计师事务所（特殊普通合伙）。本次变更事项经本基金管理人董事会审议通过，经基金托管人同意，并已向中国证券监督管理委员会及其派出机构报备。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人本报告期收到重庆证监局出具的行政监管措施，目前已采取措施改进。

本基金托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
华西证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	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	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	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》（证监基金字[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 23 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。

10.8.2 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
华西证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	216,000,000.00	12.44%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	108,000,000.00	6.22%	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	216,000,000.00	12.44%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	216,000,000.00	12.44%	-	-
广发证券	-	-	332,000,000.00	19.12%	-	-
华安证券	-	-	324,000,000.00	18.66%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	324,000,000.00	18.66%	-	-

10.9 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。

10.10 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	新华基金管理股份有限公司关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告	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	2021-01-04
2	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同及托管协议的公告	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	2021-01-08
3	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司基金转换补差费公告	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	2021-01-08
4	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台交易优惠费率的公告	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	2021-01-08
5	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在恒泰证券股份有限公司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	2021-01-16
6	新华壹诺宝货币市场基金招募说明书（更新）全文	公司网站、电子信披网站	2021-01-21
7	新华壹诺宝货币市场基金（新华壹诺宝 A）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-01-21
8	新华壹诺宝货币市场基金（新华壹诺宝 B）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-01-21

9	新华壹诺宝货币市场基金（新华壹诺宝 E）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-01-21
10	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年第 4 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	2021-01-21
11	新华壹诺宝货币市场基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-01-21
12	新华基金管理股份有限公司基金改聘会计师事务所公告	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	2021-02-03
13	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下基金在天风证券股份有限公司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	2021-02-26
14	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	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	2021-03-30
15	新华壹诺宝货币市场基金 2020 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2021-03-30
16	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、公司网站、电子信披网站	2021-04-10
17	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 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	2021-04-21
18	新华壹诺宝货币市场基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2021-04-21
19	新华基金管理股份有限公司关于法定代表人变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2021-05-08
20	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金增加北京增财基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	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	2021-05-08
21	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金增加中信期货有限责任公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	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	2021-05-11
22	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在北京恒天明泽基金销售有限公司开展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	2021-05-20
23	新华基金管理股份有限公司新华壹诺宝货币市场基金基金经理变更公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2021-05-20
24	新华壹诺宝货币市场基金（新华壹诺宝 A）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-05-21
25	新华壹诺宝货币市场基金（新华壹诺宝 B）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2021-05-21
26	新华壹诺宝货币市场基金（新华壹诺宝 E）基	公司网站、电子信披网站	2021-05-21

	金产品资料概要（更新）		
27	新华壹诺宝货币市场基金招募说明书（更新）全文	公司网站、电子信披网站	2021-05-21
28	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、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2021-05-27
29	新华基金管理股份有限公司关于在北京植信基金销售有限公司开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	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	2021-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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）《新华壹诺宝货币市场基金招募说明书》（更新）
- （七）《新华壹诺宝货币市场基金产品资料概要》（更新）
- （八）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （九）基金托管人业务资格批件及营业执照
- （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

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

二〇二一年八月二十七日