新华活期添利货币市场基金

2022 年年度报告

2022 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年三月三十日

§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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 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。

本报告中财务资料已经审计。致同会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 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 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 12
§4 管理人报告 13
4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 33
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 33
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 34
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 34
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 35
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 36
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 36
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 36
§5 托管人报告 36
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 36
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 37
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 37
§6 审计报告 37
6.1 审计意见 37
6.2 形成审计意见的基础 37
6.3 其他信息 37
6.4 管理层对财务报表的责任 38
6.5 注册会计师的责任 38
§7 年度财务报表 39
7.1 资产负债表 39
7.2 利润表 41
7.3 净资产（基金净值）变动表 42
7.4 报表附注 44
§8 投资组合报告 75
8.1 期末基金资产组合情况 75
8.2 债券回购融资情况 75
8.3 基金投资组合平均剩余期限 75
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 76

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 76
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 77
8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 77
8.8 期末按摊余成本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 78
8.9 投资组合报告附注 78
§9 基金份额持有人信息 80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 80
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 81
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 81
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 82
§10 开放式基金份额变动 82
§11 重大事件揭示 82
11.1 基金份额持有人大会决议 82
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 82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 83
11.4 基金投资策略的改变 83
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 83
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 83
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 83
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 83
11.9 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 85
11.10 其他重大事件 85
12 影响投资者决策的其他重要信息 89
§13 备查文件目录 89
13.1 备查文件目录 89
13.2 存放地点 89
13.3 查阅方式 89

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华活期添利货币市场基金		
基金简称	新华活期添利货币		
基金主代码	000903		
交易代码	000903		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 12 月 4 日		
基金管理人	新华基金管理股份有限公司		
基金托管人	平安银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	15,459,561,236.79 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E
下属分级基金的交易代码	000903	003264	005148
报告期末下属分级基金的份额总额	2,923,539,289.86 份	4,406,401,610.73 份	8,129,620,336.20 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，追求超越业绩比较基准的投资收益率。
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，其预期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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	李帅帅
	联系电话	010-68779688	0755-25878287
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		4008198866	95511-3
传真		010-68779528	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路5047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	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼
邮政编码		400010	518001
法定代表人		翟晨曦	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	致同会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 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 期间数据和指标	2022 年			2021 年			2020 年		
	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E
本期已实现收益	15,119,287.46	121,520,645.50	199,546,593.82	16,168,586.97	38,666,134.56	126,742,477.85	21,621,889.62	22,094,329.65	62,494,389.12
本期利润	15,119,287.46	121,520,645.50	199,546,593.82	16,168,586.97	38,666,134.56	126,742,477.85	21,621,889.62	22,094,329.65	62,494,389.12
本期净值收益率	1.9995%	2.0972%	2.0563%	2.2152%	2.4609%	2.4200%	2.0697%	2.3154%	2.2747%
3.1.2 期末数据和指标	**2022 年末**			**2021 年末**			**2020 年末**		
	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E
期末基金资产净值	2,923,539,289.86	4,406,401,610.73	8,129,620,336.20	735,250,497.56	8,588,146,235.51	8,383,879,288.57	791,736,885.15	1,132,838,457.35	3,095,312,380.34
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	**2022 年末**			**2021 年末**			**2020 年末**		
	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E
累计净值收益率	25.3032%	20.6739%	15.9076%	22.8469%	18.1951%	13.5721%	20.1845%	15.3563%	10.8887%

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 8 月 29 日分为 A 类（基金代码：000903）、B 类（基金代码：003264）。

4.本基金于 2017 年 9 月 7 日新增 E 类（基金代码：005148）。

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．新华活期添利 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	0.4479%	0.0020%	0.3408%	0.0000%	0.1071%	0.0020%
过去六个月	0.9229%	0.0016%	0.6829%	0.0000%	0.2400%	0.0016%
过去一年	1.9995%	0.0018%	1.3591%	0.0000%	0.6404%	0.0018%
过去三年	6.4169%	0.0018%	4.1331%	0.0000%	2.2838%	0.0018%
过去五年	13.3408%	0.0024%	6.9829%	0.0000%	6.3579%	0.0024%
自基金成立起至今	25.3032%	0.0038%	11.5200%	0.0000%	13.7832%	0.0038%

2．新华活期添利 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	0.4579%	0.0020%	0.3408%	0.0000%	0.1171%	0.0020%
过去六个月	0.9431%	0.0016%	0.6829%	0.0000%	0.2602%	0.0016%
过去一年	2.0972%	0.0019%	1.3591%	0.0000%	0.7381%	0.0019%
过去三年	7.0318%	0.0018%	4.1331%	0.0000%	2.8987%	0.0018%
过去五年	14.5451%	0.0025%	6.9829%	0.0000%	7.5622%	0.0025%
自基金成立起至今	20.6739%	0.0032%	8.9380%	0.0000%	11.7359%	0.0032%

3．新华活期添利 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
过去三个月	0.4478%	0.0020%	0.3408%	0.0000%	0.1070%	0.0020%
过去六个月	0.9227%	0.0016%	0.6829%	0.0000%	0.2398%	0.0016%
过去一年	2.0563%	0.0019%	1.3591%	0.0000%	0.6972%	0.0019%
过去三年	6.9037%	0.0018%	4.1331%	0.0000%	2.7706%	0.0018%
过去五年	14.3164%	0.0025%	6.9829%	0.0000%	7.3335%	0.0025%
自基金成立起至今	15.9076%	0.0027%	7.4429%	0.0000%	8.4647%	0.0027%

注：1.本基金利润分配是按日结转份额。

2.本基金于 2016 年 8 月 29 日分为 A 类（基金代码：000903）、B 类（基金代码：003264）。

3.本基金于 2017 年 9 月 7 日新增 E 类（基金代码：005148）。

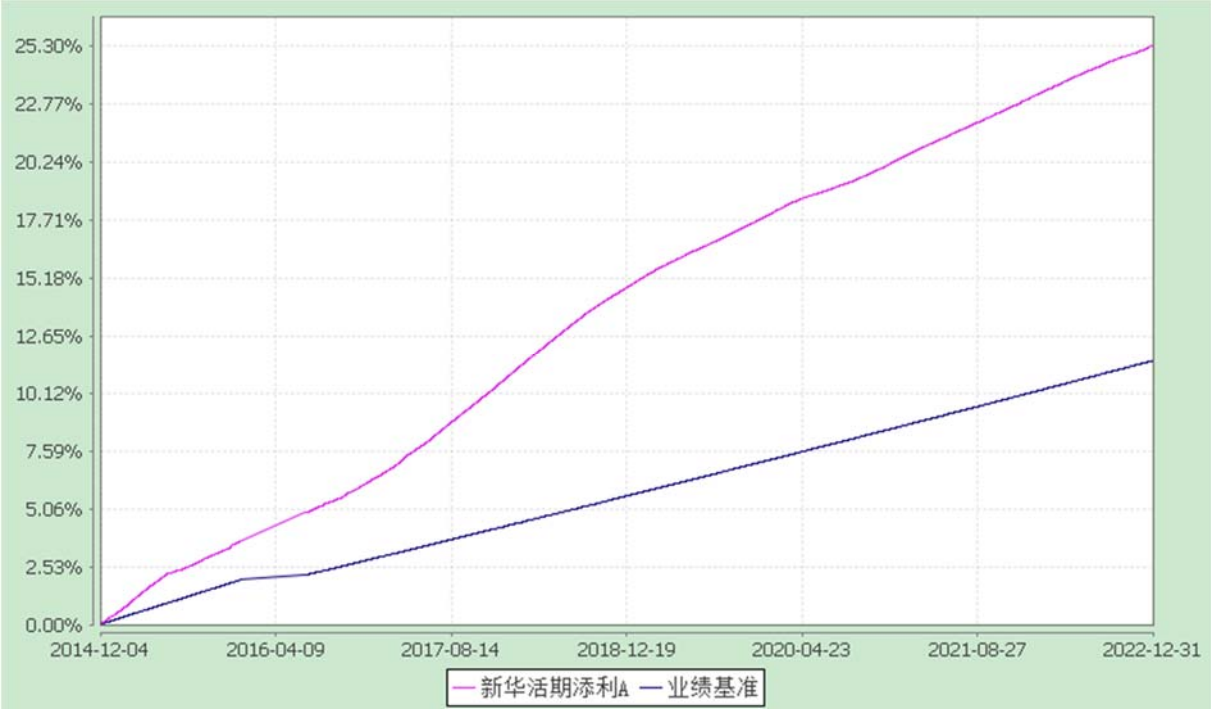
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华活期添利货币市场基金

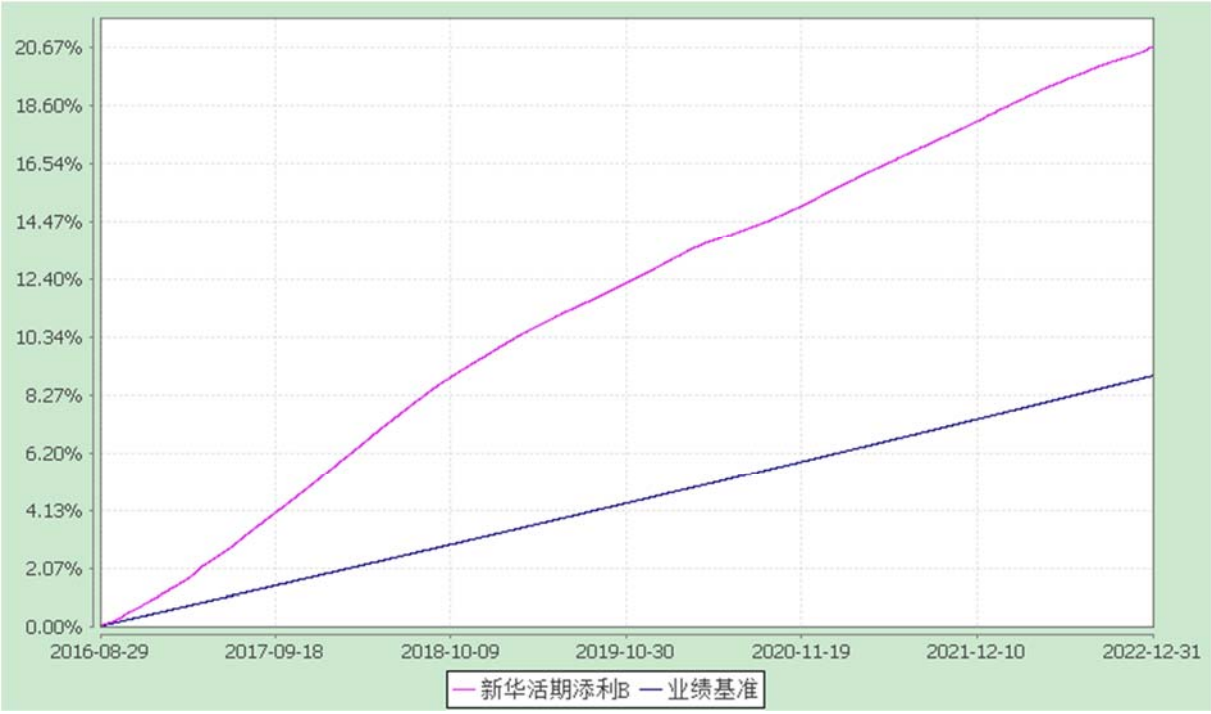
自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 12 月 4 日至 2022 年 12 月 31 日)

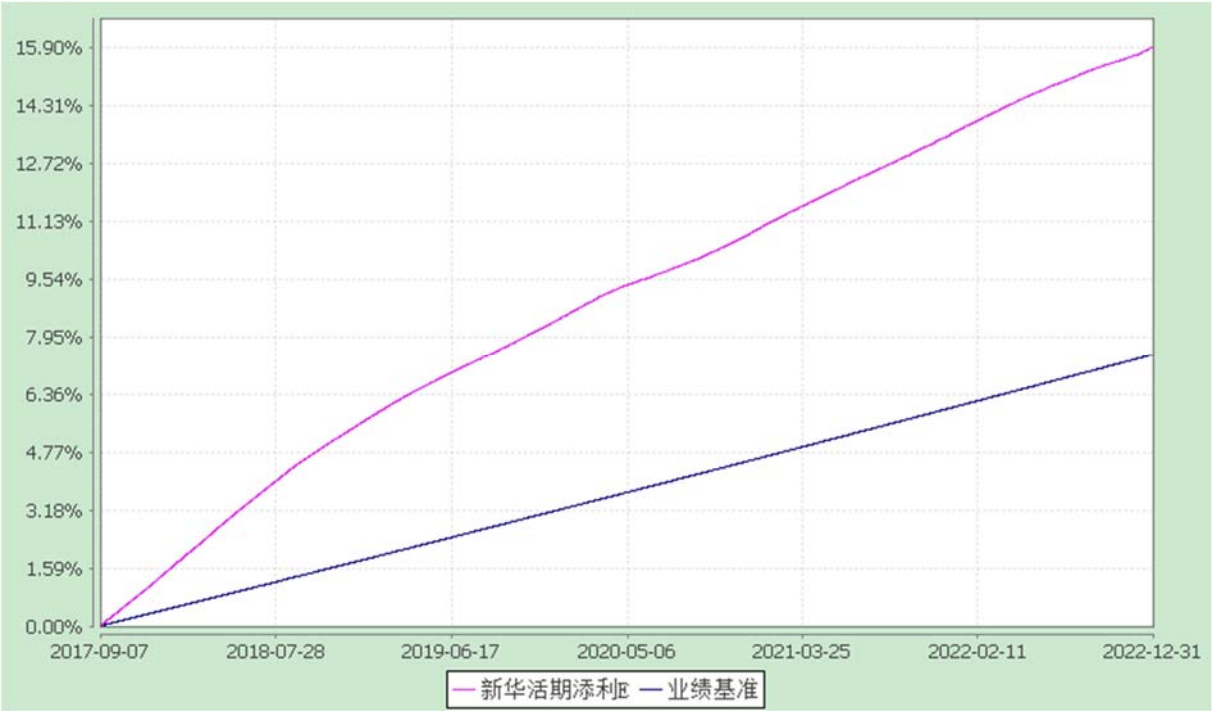
1、新华活期添利 A



2、新华活期添利 B



3、新华活期添利 E



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 8 月 29 日分为 A 类（基金代码：000903）、B 类（基金代码：003264）。

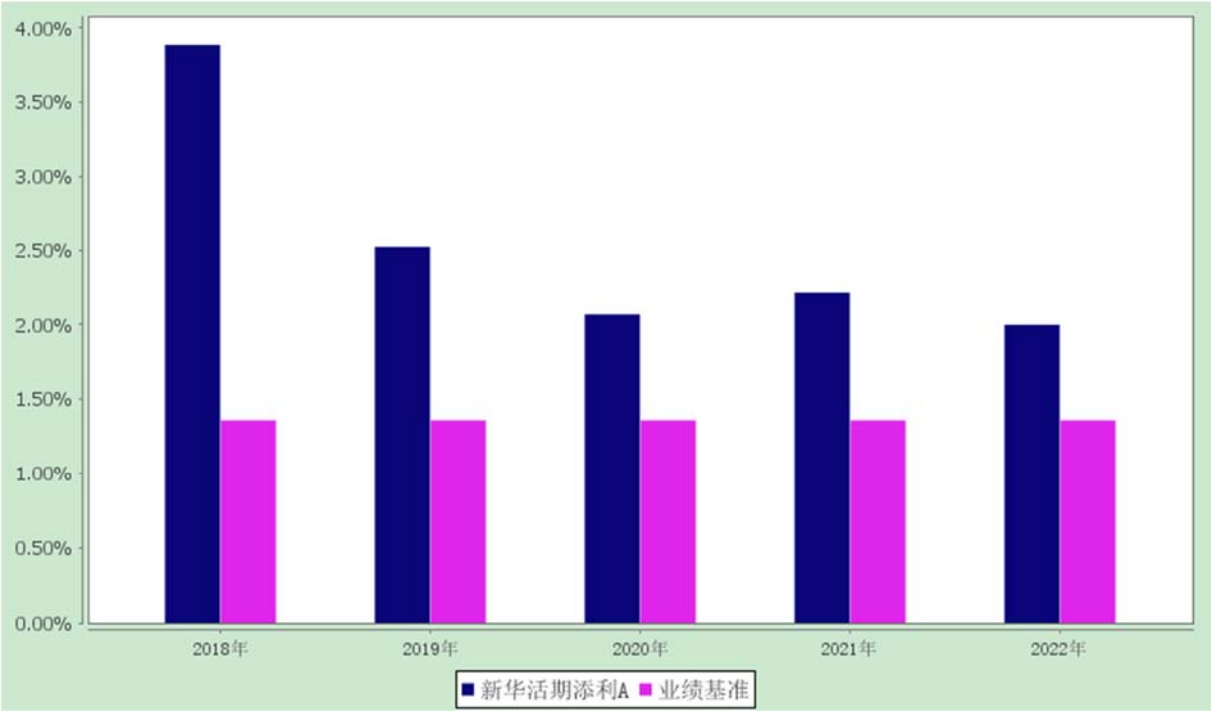
3.本基金于 2017 年 9 月 7 日新增 E 类（基金代码：005148）。

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

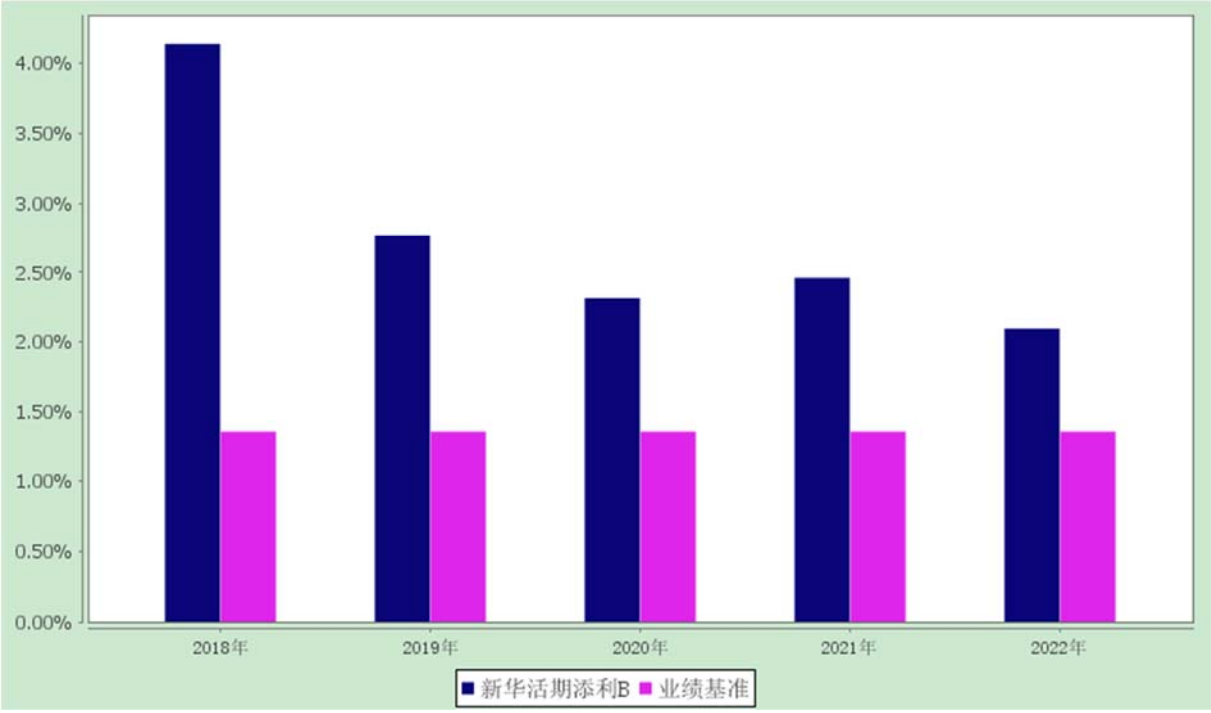
新华活期添利货币市场基金

过去五年基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

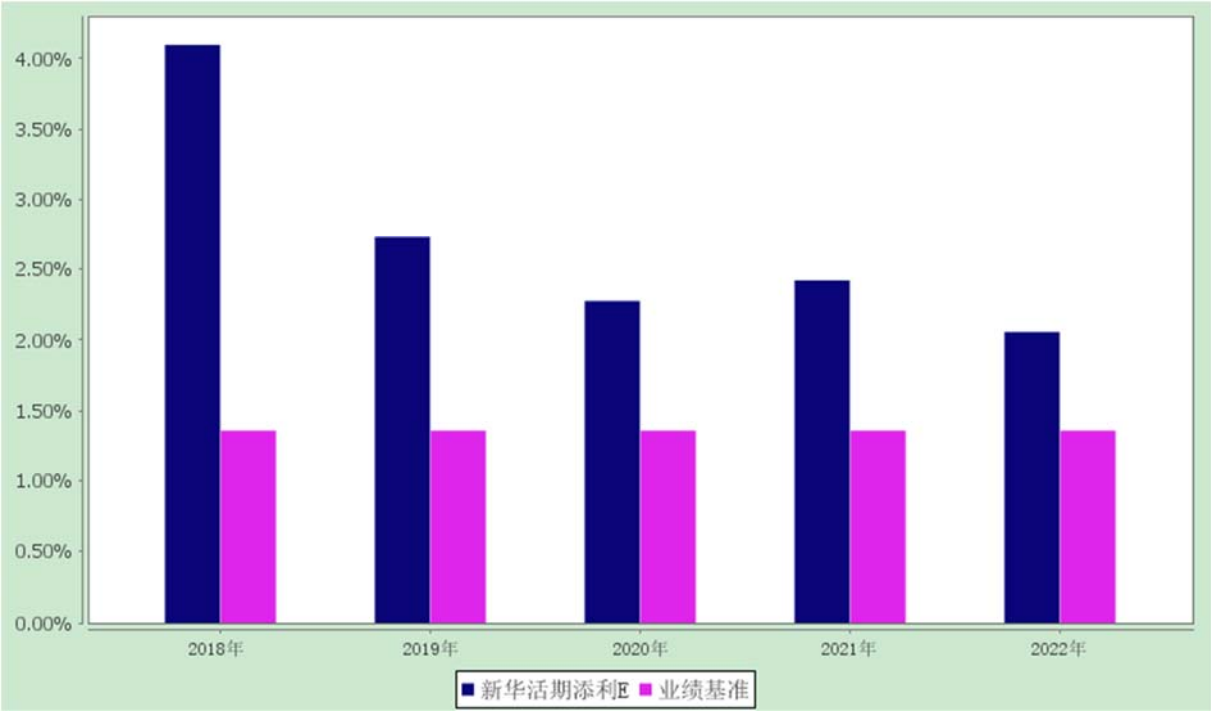
1、新华活期添利 A



2、新华活期添利 B



3、新华活期添利 E



注：1.本基金于 2016 年 8 月 29 日分为 A 类（基金代码：000903）、B 类（基金代码：003264）。

2.本基金于 2017 年 9 月 7 日新增 E 类（基金代码：005148）。

3.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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

新华活期添利 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
2022 年	14,797,595.23	-	321,692.23	15,119,287.46	-
2021 年	16,172,182.96	-	-3,595.99	16,168,586.97	-
2020 年	21,667,669.11	-	-45,779.49	21,621,889.62	-
合计	52,637,447.30	-	272,316.75	52,909,764.05	-

新华活期添利 B：

单位：人民币元

年度	已按再投资	直接通过应付赎	应付利润本年变动	年度利润分配合	备注

	形式转实收基金	回款转出金额		计	
2022 年	121,607,717.45	-	-87,071.95	121,520,645.50	-
2021 年	38,094,681.95	-	571,452.61	38,666,134.56	-
2020 年	22,074,943.78	-	19,385.87	22,094,329.65	-
合计	181,777,343.18	-	503,766.53	182,281,109.71	-

新华活期添利 E：

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
2022 年	199,144,190.65	-	402,403.17	199,546,593.82	-
2021 年	126,342,018.50	-	400,459.35	126,742,477.85	-
2020 年	62,270,604.14	-	223,784.98	62,494,389.12	-
合计	387,756,813.29	-	1,026,647.50	388,783,460.79	-

§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 2022 年 12 月 31 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十一只开放式基金，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、新华行业龙头主题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、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金。

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		
李洁	本基金基金经理，新华增强债券型证券投资基金基金经理、新华安享惠泽 39 个月	2020-05-12	-	10	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。

	定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理。				
朱韦康	本基金基金经理助理，新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、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、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华红利回报	2022-12-28	-	5	经济学博士，历任中金公司固定收益分析师，建信信托宏观策略投资和资产配置研究。

	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、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、新华丰利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、新华增怡债券				

	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、新华鑫日享中短债债券型证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、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。				
万昱东	本基金基金经理助理，新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投	2022-12-13	-	4	统计学硕士，历任天风证券固定收益总部分析师。

	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、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债1-5年农发行债券指数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、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、新华丰利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、新华增怡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、新华鑫日享中短债债券型证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、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。				
杨卓谕	本基金基金经理助理，新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、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、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金	2022-12-13	-	5	金融硕士，曾任职于天风证券机构投顾总部产品助理，投资经理。

	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、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、新华丰利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、新华增怡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、新华鑫日享中短债债券型证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、新华安享惠金定期开放债券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券投资基金基金经理助理、	2021-03-01	-	10	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、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华利率债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、新华红利回报混合型证券投资基				

	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、新华鑫回报混合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。				
于航	本基金基金经理助理，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	2020-06-03	2022-12-11	7	统计学硕士，历任新华基金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。

	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、新华鑫日享中短债债券型证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、新华安享惠金定期开放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、新华壹诺宝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、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、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券				

	指数证券投资基金基金经理助理、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。				
裴铎	本基金基金经理助理，新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、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、新华利率债债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金	2021-11-15	2022-12-11	6	国际经济学硕士，历任广发银行金融市场部交易员、投资经理。

	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、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、新华丰利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、新华增怡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、新华鑫日享中短债债券型证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、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。				
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	2020-06-03	2022-04-21	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。

	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、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、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。				

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》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4、本基金基金经理助理李晓然于 2023 年 2 月 22 日离任。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华活期添利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》、《新华活期添利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办法》，以避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。该办法规范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。

公司通过合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，使各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”作为交易执行的公平原则，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。

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管理办法》的规定。基金管理人对旗下所有投资组合间连续 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。

本报告期内，公平交易管理执行情况良好。

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

回顾 2022 年，俄乌战争、疫情反复、地产风险等多重因素影响国内经济平稳发展。一季度“稳增长”成为市场主线，在保持流动性合理充裕又“不大水漫灌”的前提下，央行降息降准助企纾困，实现稳就业、保民生。二季度以来，疫情在多个城市点状爆发，“需求收缩、供给冲击、预期转弱的三重压力”更加凸显。对此国务院调增政策性银行 8000 亿元信贷额度，加大逆周期调节；货币政策维持宽松，央行上缴利润也进一步对资金面形成支撑。四季度，防疫政策调整，地产约束因素改善，信用修复加快，复苏预期加强，债券市场调整幅度较大，引发了部分基金和理财的赎回。

市场方面，1 月降准后 DR007 围绕政策利率窄幅波动，二季度开始央行上缴利润和前期降息降准等宽松政策开始慢慢发挥作用，资金利率逐步下行，三季度 DR007 最低降至 1.3%附近，处于历史较低水平。受资金持续宽松影响，同业存单收益率下行，1 年期 AAA 同业存单收益率最低降至 1.9%，11 月债市调整后回升至 2.7%。年末央行公开市场大量投放跨年资金，紧张态势得以缓解，1 年期同业存单利率有所回落。

报告期内，基金规模有所波动，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）基金份额净值收益率为 1.9995%，同期业绩比较基准收益率为 1.3591%；本基金本报告期内（B 类）基金份额净值收益率为 2.0972%，同期业绩比较基准收益率为 1.3591%；本基金本报告期内（E 类）基金份额净值收益率为 2.0563%，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

展望后市，宏观经济整体维持恢复态势，地产、消费、基建都有望得到改善，全球总需求收缩

的话预计外需面临一定压力。货币政策逐步从宽松过渡到中性，有所收敛但不是系统性收紧。方向上经济复苏带动整体利率中枢上行，货币政策相机抉择的可能性较大，考虑到理财净值化对负债稳定有所影响，利率的波动会有所加大。中长期经济潜在增速下行大背景下，宏观经济若没有强复苏，资金利率基本是围绕政策利率中枢震荡，长端利率也不具备趋势性上行条件。市场仍需密切注意宽信用与经济社会恢复进程，总体震荡市的格局难改。

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

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值小组，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。 本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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（000903）实施利润分配的金额为 15,119,287.46 元，B 类（003264）实施利润分配的金额为 121,520,645.50 元，E 类（005148）实施利润分配的金额为 199,546,593.82 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，平安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损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§6 审计报告

致同审字（2023）第 110A005400 号

新华活期添利货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的新华活期添利货币市场基金（以下简称“新华活期添利货币基金”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表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”）发布的有关规定编制，公允反映了新华活期添利货币基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

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，我们独立于新华活期添利货币基金，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

新华活期添利货币基金基金管理人新华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）对其他信息负责。其他信息包括新华活期添利货币基金 2022 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活期添利货币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活期添利货币基金、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活期添利货币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工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）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。

（2）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。

（3）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。

（4）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，根据所获取的审计证据，

就可能导致对新华活期添利货币基金的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活期添利货币基金不能持续经营。

（5）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。

致同会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

范晓红　刘蕾

北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层

2023 年 3 月 29 日

§7　年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华活期添利货币市场基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资　产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	6,969,532,601.69	4,772,885,841.46
结算备付金		-	-
存出保证金		6,176.59	-
交易性金融资产	7.4.7.2	7,286,599,421.67	10,796,879,781.91
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,286,599,421.67	10,796,879,781.91
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	628,991,103.18	1,995,095,192.64
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		984,639,394.04	116,559,093.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.7	-	30,968,149.76
资产总计		**15,869,768,697.17**	**17,712,388,059.47**
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2022 年 12 月 31 日**	**上年度末 2021 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		404,692,452.37	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		163,393.81	302,000.00
应付管理人报酬		1,992,697.54	2,013,610.88
应付托管费		498,174.39	503,402.74
应付销售服务费		382,796.65	536,684.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		217,049.78	121,749.15
应付利润		1,978,953.11	1,341,929.66
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	281,942.73	292,660.45
负债合计		**410,207,460.38**	**5,112,037.83**
净资产：		**-**	**-**
实收基金	7.4.7.9	15,459,561,236.79	17,707,276,021.64

其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.10	-	-
净资产合计		**15,459,561,236.79**	**17,707,276,021.64**
负债和净资产总计		**15,869,768,697.17**	**17,712,388,059.47**

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，A 类（000903）基金份额净值 1.000 元，基金份额 2,923,539,289.86 份；B 类（003264）基金份额净值 1.000 元，基金份额 4,406,401,610.73 份；E 类（005148）基金份额净值 1.000 元，基金份额 8,129,620,336.20 份。

7.2 利润表

会计主体：新华活期添利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		**395,352,053.13**	**218,008,143.97**
1.利息收入		154,968,806.44	213,248,487.39
其中：存款利息收入	7.4.7.11	136,095,387.58	65,905,110.03
债券利息收入		-	131,351,937.95
资产支持证券利息收入		-	160,195.26
买入返售金融资产收入		18,873,418.86	15,831,244.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		240,383,246.69	4,759,656.58
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	240,383,246.69	4,753,647.07
资产支持证券投资收益	7.4.7.15	-	6,009.51
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
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、营业总支出		**59,165,526.35**	**36,430,944.59**
1．管理人报酬		32,737,744.45	16,495,607.47
2．托管费		8,184,436.07	4,103,019.43
3．销售服务费		6,206,683.50	4,701,126.83
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		11,663,402.38	10,859,948.47
其中：卖出回购金融资产支出		11,663,402.38	10,859,948.47
6．信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7．税金及附加		176,047.95	73,607.84
8．其他费用	7.4.7.21	197,212.00	197,634.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**336,186,526.78**	**181,577,199.38**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**336,186,526.78**	**181,577,199.38**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**336,186,526.78**	**181,577,199.38**

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华活期添利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	17,707,276,021.64	-	17,707,276,021.64
二、本期期初净资产（基金净	17,707,276,021.64	-	17,707,276,021.64

值）			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,247,714,784.85	-	-2,247,714,784.85
（一）、综合收益总额	-	336,186,526.78	336,186,526.78
（二）、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）	-2,247,714,784.85	-	-2,247,714,784.85
其中：1.基金申购款	73,209,885,654.96	-	73,209,885,654.96
2.基金赎回款	-75,457,600,439.81	-	-75,457,600,439.81
（三）、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）	-	-336,186,526.78	-336,186,526.78
四、本期期末净资产（基金净值）	15,459,561,236.79	-	15,459,561,236.79
项目	**上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产（基金净值）	5,019,887,722.84	-	5,019,887,722.84
二、本期期初净资产（基金净值）	5,019,887,722.84	-	5,019,887,722.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	12,687,388,298.80	-	12,687,388,298.80
（一）、综合收益总额	-	181,577,199.38	181,577,199.38
（二）、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）	12,687,388,298.80	-	12,687,388,298.80
其中：1.基金申购款	74,263,921,708.71	-	74,263,921,708.71
2.基金赎回	-61,576,533,409.91	-	-61,576,533,4

款			09.91
（三）、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）	-	-181,577,199.38	-181,577,199.38
四、本期期末净资产（基金净值）	17,707,276,021.64	-	17,707,276,021.64

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：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

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

新华活期添利货币市场基金(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［2014］1114 号文核准，由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于 2014 年 11 月 28 日至 2014 年 12 月 2 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 200,408,379,44 份，有效认购户数为 274 户，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2014]第 37100017 号验资报告予以验证。2014 年 12 月 4 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，基金托管人为平安银行股份有限公司。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平安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 8 月 29 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；自 2017 年 9 月 7 日起增加 E 类基金份额，并对本基金合同和托管协议进行修改。

根据《新华活期添利货币市场基金招募说明书》及《新华活期添利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、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、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 2023 年 3 月 29 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，按照财政部颁布的企业会计准则及其应用指南和解释、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他有关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华活期添利货币市场基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、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。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成

本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策：

(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、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。

本基金持有的债券投资、资产支持证券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，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。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(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及其他金融负债。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。

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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值

中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继

续适用本基金以前年度的如下会计政策：

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认： (1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金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；或者(3)该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。基金管理人应根据相关法律法规控制影子价格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绝对值，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

不适用。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资于处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策：

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券

发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资于处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，于下一工作日以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易

的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号--金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号－套期会计》及《企业会计准则第 37 号--金融工具列报》 (以下合称"新金融工具准则")，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》 (财会[2022]14 号)， 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

（1）新金融工具准则

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,772,885,841.46 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 19,335,907.43 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,792,221,748.89 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,995,095,192.64 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 529,403.96 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,995,624,596.60 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 30,968,149.76 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 19,335,907.43 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 11,102,838.37 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 529,403.96 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，应收利息于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,796,879,781.91 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 11,102,838.37 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,807,982,620.28 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

（2）《资产管理产品相关会计处理规定》、修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》、修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无会计差错更正。

7.4.6税项

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

（1）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。

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）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。

（4）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	11,913,121.11	12,885,841.46
等于：本金	11,911,418.13	12,885,841.46
加：应计利息	1,702.98	-
定期存款	6,957,619,480.58	4,760,000,000.00
等于：本金	6,950,000,000.00	4,760,000,000.00
加：应计利息	7,619,480.58	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	450,000,000.00
存款期限 1-3 个月	1,751,377,277.93	2,160,000,000.00
存款期限 3 个月以上	5,206,242,202.65	2,150,000,000.00
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	6,969,532,601.69	4,772,885,841.46

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	7,286,599,421.67	7,289,778,922.73	3,179,501.06	0.0206
	合计	7,286,599,421.67	7,289,778,922.73	3,179,501.06	0.0206
资产支持证券		-	-	-	-
合计		7,286,599,421.67	7,289,778,922.73	3,179,501.06	0.0206
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算	影子定价	偏离金额	偏离度（%）

		的账面价值			
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	10,796,879,781.91	10,802,321,000.00	5,441,218.09	0.0307
	合计	10,796,879,781.91	10,802,321,000.00	5,441,218.09	0.0307
资产支持证券		-	-	-	-
合计		10,796,879,781.91	10,802,321,000.00	5,441,218.09	0.0307

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

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	628,991,103.18	-
合计	628,991,103.18	-
项目	上年度末 2021 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	1,995,095,192.64	-
合计	1,995,095,192.64	-

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本期末及上年度末均无其他债权投资。

7.4.7.7 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	30,968,149.76
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	30,968,149.76

注：本报告期末本基金无其他资产余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 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	-	-
应付交易费用	112,942.73	123,660.45
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	112,942.73	123,660.45
应付利息	-	-
应付中国证券报	120,000.00	120,000.00
应付账户维护费	9,000.00	9,000.00
应付审计费	40,000.00	40,000.00
合计	281,942.73	292,660.45

7.4.7.9 实收基金

新华活期添利 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	735,250,497.56	735,250,497.56
本期申购	3,661,341,449.80	3,661,341,449.80
本期赎回（以“-”号填列）	-1,473,052,657.50	-1,473,052,657.50
本期末	2,923,539,289.86	2,923,539,289.86

新华活期添利 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,588,146,235.51	8,588,146,235.51
本期申购	16,134,920,464.69	16,134,920,464.69
本期赎回（以“-”号填列）	-20,316,665,089.47	-20,316,665,089.47
本期末	4,406,401,610.73	4,406,401,610.73

新华活期添利 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,383,879,288.57	8,383,879,288.57
本期申购	53,413,623,740.47	53,413,623,740.47
本期赎回（以“-”号填列）	-53,667,882,692.84	-53,667,882,692.84
本期末	8,129,620,336.20	8,129,620,336.20

注：申购含红利再投份额。

7.4.7.10 未分配利润

新华活期添利 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
本期利润	15,119,287.46	-	15,119,287.46
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	-15,119,287.46	-	-15,119,287.46
本期末	-	-	-

新华活期添利 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	121,520,645.50	-	121,520,645.50
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	-121,520,645.50	-	-121,520,645.50
本期末	-	-	-

新华活期添利 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
本期利润	199,546,593.82	-	199,546,593.82
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	-199,546,593.82	-	-199,546,593.82
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	57,924.86	44,925.94
定期存款利息收入	136,035,005.20	65,860,184.09
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,457.52	-
其他	-	-
合计	136,095,387.58	65,905,110.03

注：结算备付金利息收入包括结算保证金利息。

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	235,768,326.98	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,614,919.71	4,753,647.07
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	240,383,246.69	4,753,647.07

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	45,121,551,094.07	22,979,516,662.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	44,966,026,067.52	22,891,674,635.72
减：应计利息总额	150,910,106.84	83,088,379.43
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	4,614,919.71	4,753,647.07

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

7.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	-	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	6,009.51
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	6,009.51

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	20,143,611.99
减：卖出资产支持证券成本总额	-	20,000,000.00

减：应计利息总额	-	137,602.48
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	6,009.51

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间按照合同规定无股票投资。

7.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.19 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
中国证券报	120,000.00	120,000.00

账户维护费	36,012.00	36,584.55
查询费	1,200.00	1,050.00
合计	197,212.00	197,634.55

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

截至资产负债表日，本基金并无需要作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
新华信托股份有限公司	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
中国平安保险（集团）股份有限公司	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

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回购交易。

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	32,737,744.45	16,495,607.47
其中：支付销售机构的客户维护费	10,772,853.72	6,664,911.94

注：1、本基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/当年天数。

2、本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额，上年度可比期间列示的支付销售机构的客户维护费为当期支付金额。

7.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,184,436.07	4,103,019.43

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.05%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×0.05%/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	本期

关联方名称	2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E	合计
平安银行股份有限公司	2,510.46	1,424.83	-	3,935.29
新华基金管理股份有限公司	35,205.62	468,069.78	44,739.19	548,014.59
恒泰证券股份有限公司	13.83	5,088.23	1,223.12	6,325.18
合计	37,729.91	474,582.84	45,962.31	558,275.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	新华活期添利A	新华活期添利B	新华活期添利E	合计
平安银行股份有限公司	2,750.11	-	-	2,750.11
恒泰证券股份有限公司	41.34	210.55	23.09	274.98
新华基金管理股份有限公司	36,438.66	129,824.80	5,800.78	172,064.24
合计	39,230.11	130,035.35	5,823.87	175,089.33

注：1、2022 年 1 月 1 日至 2022 年 4 月 12 日基金 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，2022 年 4 月 13 日至 2022 年 12 月 31 日基金 A 类销售服务费按前一日基金资产净值的 0.05%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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 4 月 12 日 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，2022 年 4 月 13 日至 2022 年 12 月 31 日 A 类日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.05%/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。

2、本基金于 2017 年 9 月 7 日新增 E 类（基金代码：005148）。

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

2022年1月1日至2022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
平安银行股份有限公司	260,117,829.49	-	-	-	729,280,000.00	70,281.81
上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
平安银行股份有限公司	816,826,216.79	-	-	-	621,480,000.00	42,586.45

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 2022年1月1日至2022年12月31日			上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日		
	新华活期添利A	新华活期添利B	新华活期添利E	新华活期添利A	新华活期添利B	新华活期添利E
期初持有的基金份额	-	62,801,568.72	-	0.00	50,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	11,037.85	30,203,045.74	-	-	83,801,568.72	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	11,037.85	93,004,614.46	-	-	71,000,000.00	-
期末持有的基金份额	0.00	0.00	-	-	62,801,568.72	-

期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%	-	-	0.73%	-

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

新华活期添利 B

份额单位：份

关联方名称	新华活期添利B本期末 2022年12月31日		新华活期添利B上年度末 2021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
恒泰证券股份有限公司深圳分公司	151,942,953.32	3.45%	40,005,355.83	0.47%

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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
平安银行股份有限公司	11,913,121.11	57,924.86	12,885,841.46	44,925.94

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均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

本基金报告期内无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

1、新华活期添利 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
14,797,595.23	-	321,692.23	15,119,287.46	-

2、新华活期添利 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
121,607,717.45	-	-87,071.95	121,520,645.50	-

3、新华活期添利 E

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
199,144,190.65	-	402,403.17	199,546,593.82	-

7.4.12 期末（2022 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

本基金合同规定无股票投资。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金合同规定无股票投资。

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 2022 年 12 月 31 日，本基金从事银行间市场债券正回购形成的卖出回购金融资产款余额为 404,692,452.37 元，是以如下债券作为质押：

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
112271547	22 珠海华润银行 CD127	2023-01-03	99.64	1,000,000.00	99,636,384.62
112296858	22 广西北部湾银行 CD163	2023-01-03	99.25	1,000,000.00	99,245,083.40
112203115	22 农业银行 CD115	2023-01-03	99.43	844,000.00	83,915,433.89
112209076	22 浦发银行 CD076	2023-01-03	99.39	664,000.00	65,996,193.75
112299512	22 河北银行 CD067	2023-01-03	99.03	480,000.00	47,533,462.68
112204011	22 中国银行 CD011	2023-01-03	99.53	370,000.00	36,827,871.34
合计				4,358,000.00	433,154,429.68

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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 2022年12月31日	上年末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	784,682,808.97	2,225,386,665.54
合计	784,682,808.97	2,225,386,665.54

7.4.13.2.2 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的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 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 2022年12月31日	上年末 2021年12月31日
AAA	1,173,244,424.01	-
AAA 以下	50,016,438.36	-
未评级	-	-
合计	1,223,260,862.37	-

注：上年末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	5,228,843,413.45	8,273,759,246.17

AAA 以下	49,812,336.88	297,733,870.20
未评级	-	-
合计	5,278,655,750.33	8,571,493,116.37

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约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 2022 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	6,969,532,601.69	-	-	-	6,969,532,601.69
结算备付金	0.00	-	-	-	0.00
存出保证金	6,176.59	-	-	-	6,176.59
交易性金融资产	7,286,599,421.67	0.00	0.00	0.00	7,286,599,421.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	628,991,103.18	-	-	-	628,991,103.18
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	984,639,394.04	984,639,394.04
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	14,885,129,303.13	0.00	0.00	984,639,394.04	15,869,768,697.17
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	404,692,452.37	-	-	-	404,692,452.37
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	163,393.81	163,393.81
应付管理人报酬	-	-	-	1,992,697.54	1,992,697.54
应付托管费	-	-	-	498,174.39	498,174.39
应付销售服务费	-	-	-	382,796.65	382,796.65
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	217,049.78	217,049.78

应付利润	-	-	-	1,978,953.11	1,978,953.11
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	281,942.73	281,942.73
负债总计	404,692,452.37	0.00	0.00	5,515,008.01	410,207,460.38
利率敏感度缺口	14,480,436,850.76	0.00	0.00	979,124,386.03	15,459,561,236.79
上年度末 2021 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	4,772,885,841.46	-	-	-	4,772,885,841.46
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	10,796,879,781.91	-	-	-	10,796,879,781.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,995,095,192.64	-	-	-	1,995,095,192.64
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	30,968,149.76	30,968,149.76
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	116,559,093.70	116,559,093.70
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,564,860,816.01	-	-	147,527,243.46	17,712,388,059.47
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	-	-	-	302,000.00	302,000.00

应付管理人报酬	-	-	-	2,013,610.88	2,013,610.88
应付托管费	-	-	-	503,402.74	503,402.74
应付销售服务费	-	-	-	536,684.95	536,684.95
应付交易费用	-	-	-	123,660.45	123,660.45
应交税费	-	-	-	121,749.15	121,749.15
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	1,341,929.66	1,341,929.66
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	169,000.00	169,000.00
负债总计	-	-	-	5,112,037.83	5,112,037.83
利率敏感度缺口	17,564,860,816.01	-	-	142,415,205.63	17,707,276,021.64

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

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	减少约 4,268,108.28	减少约 6,779,489.71
	市场利率下降 25.00 bp	增加约 4,274,308.39	增加约 6,791,007.02

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	7,286,599,421.67	10,796,879,781.91
第三层次	-	-
合计	7,286,599,421.67	10,796,879,781.91

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债， 其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	7,286,599,421.67	45.91
	其中：债券	7,286,599,421.67	45.91
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	628,991,103.18	3.96
	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	6,969,532,601.69	43.92
4	其他各项资产	984,645,570.63	6.20
5	合计	15,869,768,697.17	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	4.41	
	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	404,692,452.37	2.62
	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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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	3.89	2.62
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	40.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	36.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		96.16	2.62

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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期无超过 240 天的情况。

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	358,177,335.37	2.32
2	央行票据	-	-

3	金融债券	426,505,473.60	2.76
	其中：政策性金融债	426,505,473.60	2.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,223,260,862.37	7.91
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,278,655,750.33	34.14
8	其他	-	-
9	合计	7,286,599,421.67	47.13
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	112271728	22 晋商银行 CD177	2,500,000.00	247,532,619.75	1.60
2	112217028	22 光大银行 CD028	2,000,000.00	199,237,349.04	1.29
3	112221225	22 渤海银行 CD225	2,000,000.00	199,050,781.89	1.29
4	112206253	22 交通银行 CD253	2,000,000.00	197,929,560.01	1.28
5	112215256	22 民生银行 CD256	2,000,000.00	197,697,169.50	1.28
6	112205001	22 建设银行 CD001	1,500,000.00	149,808,550.41	0.97
7	112271467	22 天津银行 CD352	1,500,000.00	149,458,161.18	0.97
8	112206075	22 交通银行 CD075	1,500,000.00	149,404,759.66	0.97
9	112219279	22 恒丰银行 CD279	1,500,000.00	148,495,035.30	0.96
10	112283406	22 九江银行 CD086	1,500,000.00	147,882,523.48	0.96

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	0.1157%
报告期内偏离度的最低值	-0.0117%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0491%

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 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末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是否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

1、“22 光大银行 CD028”发行人中国光大银行股份有限公司：

（1）理财业务存在违法违规行为，被处以罚款 400 万元。（银保监罚决字〔2022〕31 号，2022 年 5 月 24 日）

（2）未按《投诉办法》统计、报告和披露投诉数据，违反《中华人民共和国银行业监督管理法》关于银行业金融机构应当严格遵守审慎经营规则的规定，被通报批评。（中国银保监会消费者权益保护局，2022 年第 7 号通报《关于部分银行保险机构违反<银行业保险业消费投诉处理管理办法>的情况通报》，2022 年 4 月 29 日）

（3）因光大银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在 18 项违法违规行为，银保监会对其处以 490 万元的罚款。（银保监罚决字〔2022〕18 号，2022 年 3 月 21 日）

2、“22 渤海银行 CD225”发行人渤海银行股份有限公司，因监管标准化数据（EAST）系统数据质

量及数据报送存在15项违法违规行为，被银保监会处罚360万元。（银保监罚决字〔2022〕28号，2022年3月21日）

3、“22交通银行CD253”发行人交通银行股份有限公司：

（1）因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人消费贷款违规流入房地产市场、总行对分支机构管控不力承担管理责任，中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款500万元。（银保监罚决字〔2022〕46号，2022年9月9日）

（2）因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送15项违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款420万元。（银保监罚决字〔2022〕15号，2022年3月21日）

4、“22民生银行CD256”发行人中国民生银行股份有限公司：

（1）因信用卡中心催收严重不审慎，被北京银保监局责令改正并处以80万元罚款。（京银保监罚决字〔2022〕16号）

（2）中国民生银行因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送 16 项违法违规行为被罚款490万元。（银保监罚决字〔2022〕20号，2022年3月21日）

5、“22建设银行CD001”发行人中国建设银行股份有限公司：

（1）因在理财业务方面存在老产品规模在部分时点出现反弹的问题，被银保监会罚款200万元。（银保监罚决字〔2022〕51号，2022年9月30日)

（2）因存在个人经营贷款“三查”不到位、个人经营贷款制度不审慎、总行对分支机构管控不力承担管理责任情况，被银保监会罚款260万元。（银保监罚决字〔2022〕44号，2022年9月9日)

（3）作为山东胜通集团股份有限公司相关债务融资工具主承销商，在“16胜通MTN001”尽职调查过程中，未就涉及山东胜通第一大主营业务的异常情况保持合理怀疑并进行充分核查，尽职调查个别环节未规范开展，2022年4月银行间市场交易商协会对建设银行予以通报批评、责令整改。

（4）因贸易融资业务EAST数据存在偏差、贷款核销业务EAST数据存在偏差等多项违法违规行为，被银保监会处以罚款470万元。（银保监罚决字〔2022〕14号，2022年3月21日)

6、“22交通银行CD075”发行人交通银行股份有限公司：

（1）因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人消费贷款违规流入房地产市场、总行对分支机构管控不力承担管理责任，中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款500万元。（银保监罚决字〔2022〕46号，2022年9月9日）

（2）因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送15项违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款420万元。（银保监罚决字〔2022〕15号，2022年3月21日）

7、“22恒丰银行CD279”发行人恒丰银行股份有限公司：

（1）因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送 18 项违法违规行为被罚款 480 万元。（银保监罚决字〔2022〕26 号，2022 年 3 月 21 日）

（2）作为山东胜通相关债务融资工具主承销商，在“17 胜通 MTN001”“17 胜通 MTN002”尽职调查过程中，未就涉及山东胜通第一大主营业务的异常情况保持合理怀疑并进行充分核查，未对山东胜通子公司山东胜通化工有限公司进行实地调查、进而未能发现该子公司已经停产的事实，尽职调查个别环节未规范开展，2022 年 4 月银行间市场交易商协会对恒丰银行予以警告、责令整改。

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。

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	6,176.59
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	984,639,394.04
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	984,645,570.63

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
新华活期添利 A	139,355	20,979.08	52,444,584.43	1.79%	2,871,094,705.43	98.21%
新华活期添利 B	85	51,840,018.95	4,378,253,186.96	99.36%	28,148,423.77	0.64%
新华活期添利 E	774,780	10,492.81	347,438,393.86	4.27%	7,782,181,942.34	95.73%
合计	914,220	16,910.11	4,778,136,165.25	30.91%	10,681,425,071.54	69.09%

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	券商类机构	204,290,652.61	1.32%
2	银行类机构	204,183,369.79	1.32%
3	券商类机构	203,340,360.34	1.32%
4	银行类机构	201,588,629.82	1.30%
5	银行类机构	201,443,795.86	1.30%
6	银行类机构	200,156,117.55	1.29%
7	银行类机构	200,012,201.83	1.29%
8	保险类产品	200,012,201.83	1.29%
9	券商类机构	151,942,953.32	0.98%
10	保险类产品	150,674,981.77	0.97%

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	新华活期添利 A	247.37	0.00%
	新华活期添利 B	0.00	0.00%
	新华活期添利 E	2,021,068.35	0.02%
	合计	2,021,315.72	0.01%

注：本公司所有从业人员持有本基金份额总量为 2,021,315.72 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	新华活期添利 A	0
	新华活期添利 B	0
	新华活期添利 E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	新华活期添利 A	0
	新华活期添利 B	0
	新华活期添利 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；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	新华活期添利 A	新华活期添利 B	新华活期添利 E
基金合同生效日（2014 年 12 月 4 日）基金份额总额	200,408,379.44	-	-
本报告期期初基金份额总额	735,250,497.56	8,588,146,235.51	8,383,879,288.57
本报告期基金总申购份额	3,661,341,449.80	16,134,920,464.69	53,413,623,740.47
减：本报告期基金总赎回份额	1,473,052,657.50	20,316,665,089.47	53,667,882,692.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,923,539,289.86	4,406,401,610.73	8,129,620,336.20

§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

2023 年 2 月 28 日，翟晨曦女士离任公司董事长，于春玲女士代任公司董事长，刘征宇先生由于个人原因不再担任副总经理。本报告期，公司董事项琥先生离任，增补李磊先生为董事。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人与原深圳办公区所租房屋的房东黄淑娴与二房东（承租人）之间存在房屋占用费的纠纷案件，该案件等待二审开庭；基金管理人专户产品众富 1 号交易对手湖北蕲春农商行对公司发起诉讼，目前该案件等待开庭审理。

本报告期未有涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内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

本报告期内为本基金进行审计的会计师事务所为致同会计师事务所（特殊普通合伙）。报告年度应支付给其报酬 40000 元人民币。审计年限为 1 年。自 2020 年，致同会计师事务所为本基金连续提供 3 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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2022-07-08
采取稽查或处罚等措施的机构	重庆证监局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改措施
其他	-

11.7.1 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总额的比例		金总量的比例	
光大证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
西部证券	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 22 个交易席位，其中报告期内新增 6 个交易席位，退租 3 个交易席位。新增席位为：国海证券上海席位、国海证券深圳席位、国联证券上海席位、国联证券深圳席位、江海证券深圳席位、山西证券深圳席位；退租席位为：国海证券上海席位、西部证券上海席位、西部证券深圳席位。

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
光大证券	272,031,113.15	100.00%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

11.9 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金报告期内无偏离度绝对值超过 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	新华基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-04
2	新华基金管理股份有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-01-13
3	新华基金管理股份有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-01-13
4	新华活期添利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	2022-01-14
5	新华活期添利货币市场基金（新华活期添利 A）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-01-14
6	新华活期添利货币市场基金（新华活期添利 B）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-01-14
7	新华活期添利货币市场基金（新华活期添利 E）基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-01-14
8	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 年 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	2022-01-21
9	新华活期添利货币市场基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-01-21
10	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为代销机构并开通相关业务及参加网上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	2022-02-24
11	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上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	2022-02-25
12	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中植基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上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	2022-03-02
13	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上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	2022-03-07
14	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华鑫证券证券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	2022-03-12
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中信百信银行股份有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动	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	2022-03-16

	的公告		
16	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上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	2022-03-18
17	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换业务及参加网上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	2022-03-28
18	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 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	2022-03-30
19	新华活期添利货币市场基金 2021 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2022-03-30
20	新华基金管理股份有限公司关于开展新华活期添利货币市场基金 A 类份额销售服务费优惠活动的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-04-12
21	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海利得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	2022-04-15
22	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加五矿证券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	2022-04-20
23	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 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	2022-04-21
24	新华活期添利货币市场基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-04-21
25	新华基金管理股份有限公司关于新华活期添利货币市场基金增加国泰君安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-04-26
26	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海攀赢基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-04-29
27	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增加博时财富基金销售有限公司作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	2022-05-09
28	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增加中信银行股份有限公司作为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、公司网站、电子信披网站	2022-05-13
29	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原证券有限责任公司为销售机构的公告	中国证券报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-05-31

30	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增加英大证券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	2022-06-22
31	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广发证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、公司网站、电子信披网站	2022-06-29
32	新华活期添利货币市场基金 2022 年第 2 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-07-20
33	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金增加华宝证券股份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	2022-07-22
34	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东方证券股份有限公司为销售机构、参加费率优惠活动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、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-07-22
35	新华基金管理股份有限公司关于部分基金增加华金证券股份有限公司作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	2022-08-12
36	新华活期添利货币市场基金 2022 年中期报告	公司网站、电子信披网站	2022-08-30
37	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招商证券股份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	2022-09-20
38	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海陆享基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上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	2022-09-28
39	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加银河期货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	2022-09-30
40	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为销售机构、参加费率优惠活动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	2022-10-21
41	新华活期添利货币市场基金 2022 年第 3 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-10-25
42	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加红塔证券股份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、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-10-26
43	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京坤元基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上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	2022-10-27

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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活期添利货币市场基金募集的文件

(二)关于申请募集新华活期添利货币市场基金之法律意见书

(三)新华活期添利货币市场基金基金合同

(四)新华活期添利货币市场基金托管协议

(五)新华活期添利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《新华活期添利货币市场基金招募说明书》

(八)《新华活期添利货币市场基金招募说明书》（更新）

(九)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程

(十)基金托管人业务资格批件和营业执照

(十一)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

(十二)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

二〇二三年三月三十日