

# 新华壹诺宝货币市场基金

## 2025 年中期报告

### 2025 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：二〇二五年八月二十八日

## 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 2025 年 8 月 27 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 2025 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                          | 5  |
| 2.4 | 信息披露方式                               | 6  |
| 2.5 | 其他相关资料                               | 6  |
| 3   | 主要财务指标和基金净值表现                        | 6  |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标                          | 6  |
| 3.2 | 基金净值表现                               | 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合规守信情况的说明               | 14 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                  | 15 |
| 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              | 15 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望              | 16 |
| 4.6 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                 | 16 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                  | 16 |
| 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        | 16 |
| 5   | 托管人报告                                | 17 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                   | 17 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  | 17 |
| 5.3 | 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见        | 17 |
| 6   | 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 17 |
| 6.1 | 资产负债表                                | 17 |
| 6.2 | 利润表                                  | 18 |
| 6.3 | 净资产变动表                               | 20 |
| 6.4 | 报表附注                                 | 21 |
| 7   | 投资组合报告                               | 40 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况                           | 40 |
| 7.2 | 债券回购融资情况                             | 41 |
| 7.3 | 基金投资组合平均剩余期限                         | 41 |
| 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          | 42 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合                     | 42 |
| 7.6 | 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 42 |
| 7.7 | “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离       | 43 |
| 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    | 43 |
| 7.9 | 投资组合报告附注                             | 43 |
| 8   | 基金份额持有人信息                            | 45 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构                    | 45 |
| 8.2 | 期末货币市场基金前十名份额持有人情况                   | 45 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 45 |
| 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 .....  | 46 |
| 9 开放式基金份额变动 .....                        | 46 |
| 10 重大事件揭示 .....                          | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 46 |
| 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 .....   | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 47 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....            | 47 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 47 |
| 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 .....      | 47 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 47 |
| 10.9 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....              | 49 |
| 10.10 其他重大事件 .....                       | 49 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 50 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 50 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 50 |
| 12 备查文件目录 .....                          | 50 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 50 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 50 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 50 |

## 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      | 3,342,691,344.93 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 | 2,335,613,121.46 份 | 1,006,909,256.75 份 | 168,966.72 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。本基金的主要投资策略包括：利率趋势分析、期限结构配置、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、现金流管理策略等。 |
| 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<br>负责人 | 姓名   | 齐岩                  | 王小飞                    |
|             | 联系电话 | 010-68779688        | 021-60637103           |
|             | 电子邮箱 | qiyan@ncfund.com.cn | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 4008198866          | 021-60637228           |
| 传真          |      | 010-68779528        | 021-60635778           |
| 注册地址        |      | 重庆市江北区聚贤岩广场6号       | 北京市西城区金融大街25号          |

|       |                                                        |                   |
|-------|--------------------------------------------------------|-------------------|
|       | 力帆中心2号楼19层                                             |                   |
| 办公地址  | 重庆市江北区聚贤岩广场6号<br>力帆中心2号楼19层,北京市西城区平安里西大街26号新时代大厦9层、11层 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码  | 400010                                                 | 100033            |
| 法定代表人 | 银国宏                                                    | 张金良               |

## 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（2025 年 1 月 1 日至 2025 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       | 17,536,917.67                        | 6,129,550.32     | 2,166.73   |
| 本期利润          | 17,536,917.67                        | 6,129,550.32     | 2,166.73   |
| 本期净值收益率       | 0.5594%                              | 0.6784%          | 0.6583%    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 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      | 2,335,613,121.46                     | 1,006,909,256.75 | 168,966.72 |
| 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(2025 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       | 33.3189%                             | 23.6651%         | 4.4888%    |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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, 2016 年 10 月 24 日分为 A 类(基金代码: 000434)、B 类(基金代码: 003267)。本基金自 2020 年 3 月 4 日起增加 E 类基金份额(基金代码:009099), 份额首次确认日为 2021 年 3 月 11 日, 增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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      | 0.0986%  | 0.0014%     | 0.1110%    | 0.0000%       | -0.0124% | 0.0014% |
| 过去三个月      | 0.2869%  | 0.0009%     | 0.3371%    | 0.0000%       | -0.0502% | 0.0009% |
| 过去六个月      | 0.5594%  | 0.0010%     | 0.6717%    | 0.0000%       | -0.1123% | 0.0010% |
| 过去一年       | 1.2304%  | 0.0013%     | 1.3572%    | 0.0000%       | -0.1268% | 0.0013% |
| 过去三年       | 4.6125%  | 0.0018%     | 4.1331%    | 0.0000%       | 0.4794%  | 0.0018% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.3189% | 0.0045%     | 16.9135%   | 0.0000%       | 16.4054% | 0.0045% |

##### 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      | 0.1184%  | 0.0014%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0074%  | 0.0014% |
| 过去三个月      | 0.3470%  | 0.0009%     | 0.3371%    | 0.0000%       | 0.0099%  | 0.0009% |
| 过去六个月      | 0.6784%  | 0.0010%     | 0.6717%    | 0.0000%       | 0.0067%  | 0.0010% |
| 过去一年       | 1.4680%  | 0.0013%     | 1.3572%    | 0.0000%       | 0.1108%  | 0.0013% |
| 过去三年       | 5.3632%  | 0.0018%     | 4.1331%    | 0.0000%       | 1.2301%  | 0.0018% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.6651% | 0.0032%     | 12.4386%   | 0.0000%       | 11.2265% | 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 | 0.1151%  | 0.0014%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0041%  | 0.0014% |
| 过去三个月 | 0.3369%  | 0.0009%     | 0.3371%    | 0.0000%       | -0.0002% | 0.0009% |
| 过去六个月 | 0.6583%  | 0.0010%     | 0.6717%    | 0.0000%       | -0.0134% | 0.0010% |
| 过去一年  | 1.4273%  | 0.0013%     | 1.3572%    | 0.0000%       | 0.0701%  | 0.0013% |
| 过去三年  | 4.4888%  | 0.0024%     | 4.1331%    | 0.0000%       | 0.3557%  | 0.0024% |

|            |         |         |         |         |          |         |
|------------|---------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 自基金合同生效起至今 | 4.4888% | 0.0027% | 5.9865% | 0.0000% | -1.4977% | 0.0027% |
|------------|---------|---------|---------|---------|----------|---------|

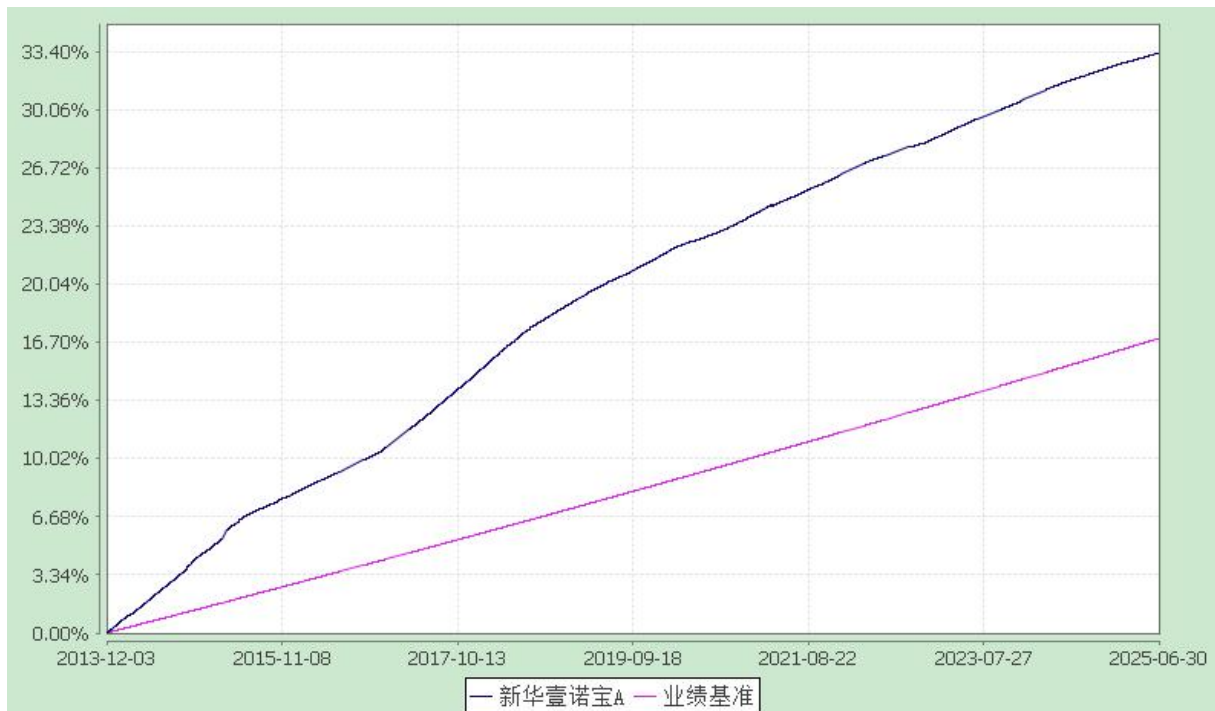
注：本基金于 2013 年 12 月 3 日基金合同生效，2016 年 10 月 24 日分为 A 类（基金代码：000434）、B 类（基金代码：003267）。本基金自 2020 年 3 月 4 日起增加 E 类基金份额（基金代码：009099），份额首次确认日为 2021 年 3 月 11 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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

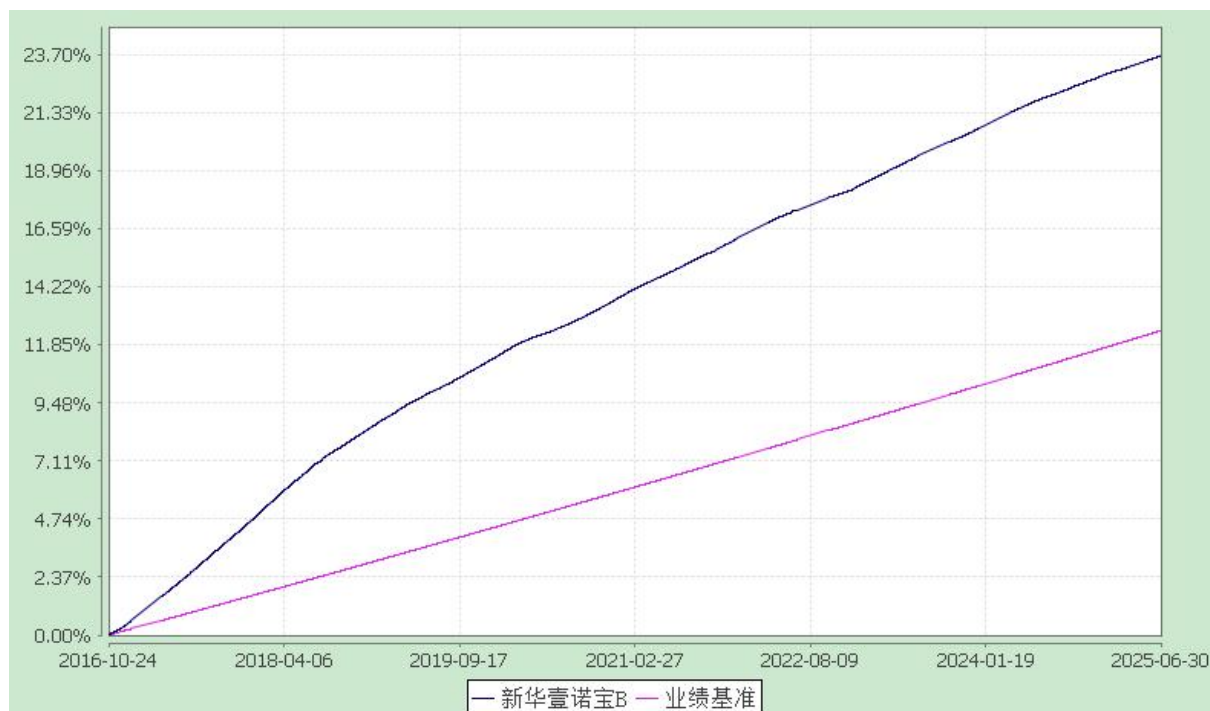
#### 新华壹诺宝货币市场基金

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 2025 年 6 月 30 日)

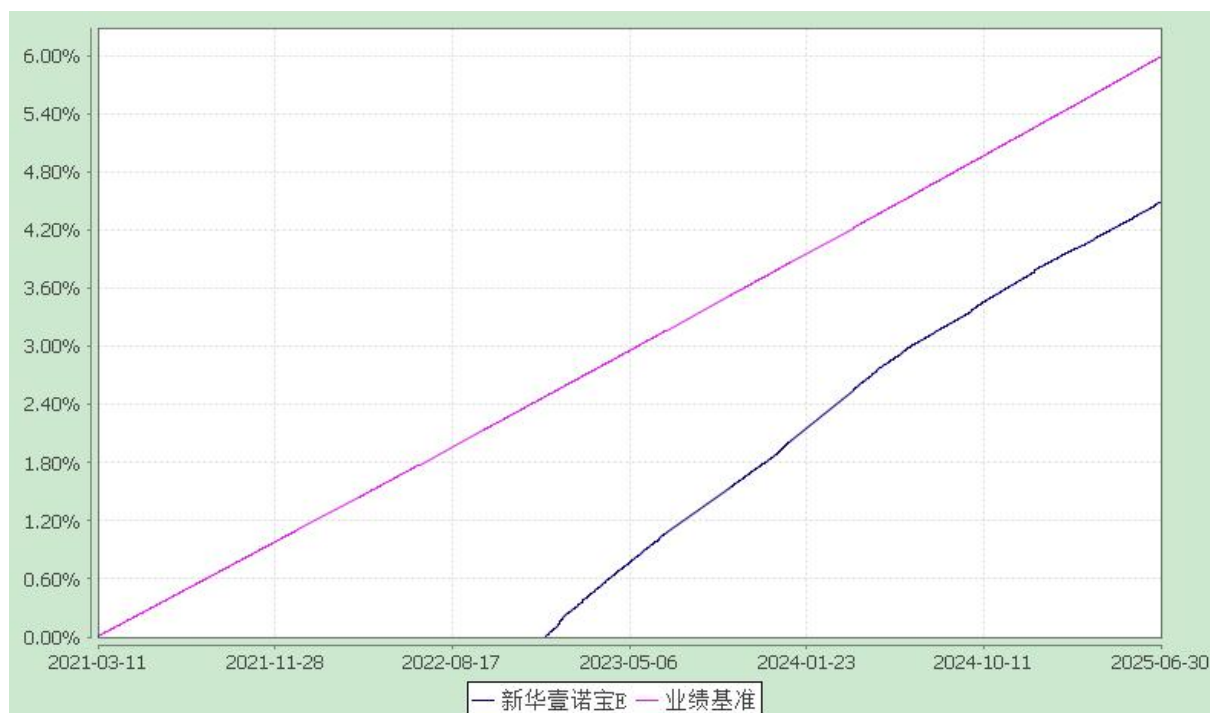
##### 新华壹诺宝 A



##### 新华壹诺宝 B



新华壹诺宝 E



注:本基金于2013年12月3日基金合同生效,2016年10月24日分为A类(基金代码:000434)、B类(基金代码:003267)。本基金自2020年3月4日起增加E类基金份额(基金代码:009099),份额首次确认日为2021年3月11日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

## 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，是我国西部首家公募基金管理公司。

截至 2025 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十七只开放式基金，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、新华中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、新华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中证 A500 指数增强型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理 | 证券从业 | 说明 |
|----|----|-----------|------|----|
|----|----|-----------|------|----|

|     |                                                                                                        | (助理) 期限    |      | 年限 |                                                   |
|-----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|------|----|---------------------------------------------------|
|     |                                                                                                        | 任职日期       | 离任日期 |    |                                                   |
| 李洁  | 本基金基金经理，新华活期添利货币市场基金基金经理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理、新华利率债债券型证券投资基金基金经理。 | 2020-07-13 | -    | 13 | 经济学硕士，曾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。 |
| 朱韦康 | 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、新华鼎利债券型证券投                                | 2022-12-28 | -    | 8  | 经济学博士，曾任中金公司固定收益分析师，建信信托投资经理。                     |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |  |  |  |  |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|
| <p>资基金基金<br/>基金经理助<br/>理、新华<br/>活期添利<br/>货币市场<br/>基金基金<br/>经理助<br/>理、新华<br/>鑫日享中<br/>短债债券<br/>型证券投资<br/>基金基金<br/>基金经理助<br/>理、新华<br/>安享惠泽<br/>39个月<br/>定期开放<br/>债券型证<br/>券投资基<br/>金基金经<br/>理助理、<br/>新华丰利<br/>债券型证<br/>券投资基<br/>金基金经<br/>理助理、<br/>新华安享<br/>惠融 88<br/>个月定期<br/>开放债券<br/>型证券投资<br/>基金基金<br/>基金经理助<br/>理、新华<br/>中债 1-5<br/>年农发行<br/>债券指数<br/>证券投资<br/>基金基金<br/>经理助<br/>理、新华<br/>利率债债<br/>券型证券<br/>投资基<br/>基金经</p> |  |  |  |  |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|

|    |                                                                                                           |            |   |    |                                   |
|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|----|-----------------------------------|
|    | 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、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理助理。 |            |   |    |                                   |
| 于航 | 本基金基金经理助理，新华丰利债券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、新华双利债券型证券投资基金基金经理                              | 2024-08-27 | - | 10 | 统计学硕士，曾任新华基金固定收益与平衡投资部研究员，基金经理助理。 |

|  |                                                                                                                      |  |  |  |  |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|
|  | 助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券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、新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华中债 0-3 年政策性金融债指数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，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《基金从业人员管理规则》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

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 情形。

#### 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

上半年宏观经济增长稳中有进、韧性较强，GDP 同比增长 5.3%，超过全年 5% 的目标。同时结构分化也较为明显，生产端维持偏强增长态势，工业增加值上半年累计同比增速 6.4%；需求端内需主要由消费支撑，投资方面增速放缓，出口表现在外需波动加剧的背景下有所超预期。政策组合上，财政政策和货币政策协同发力，财政扩张有所前置，债券发行提速，但是企业贷款需求仍显疲弱，宽信用的实现还需要时间。货币政策以稳为主，一季度资金面有所收紧，不过 5 月降准降息后资金价格回落明显，1 年期 AAA 同业存单收益率由一季度 2.03% 高点下行 40bp 至半年末 1.63%。债券市场震荡加剧，10 年国债收益率先上后下，整体波动区间为 1.60%-1.90%。

报告期内，本基金规模有所波动，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，保障组合充足流动性，同时根据规模及配置时点合理调整各类资产配置比例，在提供充分流动性保证的情况下为持有人获取了较好的投资回报。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内 A 类基金份额净值收益率为 0.5594%，同期业绩比较基准收益率为 0.6717%，B 类基金份额净值收益率为 0.6784%，同期业绩比较基准收益率为 0.6717%，E 类基金份额净值收益率为 0.6583%，同期业绩比较基准收益率为 0.6717%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全年经济增长目标完成压力较小，但是下半年经济增长动能或有所减弱，关税的实际冲击以及地产的磨底情况仍有待观察。货币政策发力点可能在于结构性货币政策，财政政策方面可能继续消费补贴、加大基建投资、推动产能过剩行业整合等。展望后市，预计债市将延续高波动的特征，但整体环境仍受货币政策宽松、经济弱复苏及外部风险交织的影响。震荡环境中，可适当维持逆向思维参与交易。

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，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

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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。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委员会，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。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。

#### 4.7 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 A 类实施利润分配的金额为 17,536,917.67 元，B 类实施利润分配的金额为 6,129,550.32 元，E 类实施利润分配的金额为 2,166.73 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

本基金本报告期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元的情形。

## 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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                        |                          |
| 货币资金        | 6.4.7.1 | 176,372,963.57         | 1,281,057,834.53         |
| 结算备付金       |         | -                      | -                        |
| 存出保证金       |         | 946.30                 | 1,528.16                 |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 2,372,540,368.60       | 3,285,662,911.00         |
| 其中：股票投资     |         | -                      | -                        |
| 基金投资        |         | -                      | -                        |
| 债券投资        |         | 2,372,540,368.60       | 3,285,662,911.00         |
| 资产支持证券投资    |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资       |         | -                      | -                        |

|               |            |                                |                                  |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | 710,209,727.10                 | 1,352,192,729.62                 |
| 应收清算款         |            | 50,046,027.40                  | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 35,318,341.94                  | 217,140,626.33                   |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 3,344,488,374.91               | 6,136,055,629.64                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                |                                  |
| 短期借款          |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                              | -                                |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 810,664.51                     | 1,055,451.61                     |
| 应付托管费         |            | 245,655.91                     | 319,833.78                       |
| 应付销售服务费       |            | 496,205.33                     | 476,417.59                       |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 16,743.49                      | 33,908.13                        |
| 应付利润          |            | 110,113.42                     | 259,654.58                       |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 117,647.32                     | 222,947.59                       |
| 负债合计          |            | 1,797,029.98                   | 2,368,213.28                     |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 3,342,691,344.93               | 6,133,687,416.36                 |
| 其他综合收益        |            | -                              | -                                |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 0.00                           | 0.00                             |
| 净资产合计         |            | 3,342,691,344.93               | 6,133,687,416.36                 |
| 负债和净资产总计      |            | 3,344,488,374.91               | 6,136,055,629.64                 |

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 3,342,691,344.93 份。其中：A 类基金份额净值 1.000 元，基金份额 2,335,613,121.46 份；B 类基金份额净值 1.000 元，基金份额 1,006,909,256.75 份；E 类基金份额净值 1.000 元，基金份额 168,966.72 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>             |          | <b>37,097,354.05</b>                     | <b>60,482,824.77</b>                          |
| 1.利息收入                     |          | 9,590,490.10                             | 32,391,137.28                                 |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.9  | 5,520,339.27                             | 23,874,198.59                                 |
| 债券利息收入                     |          | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 4,070,150.83                             | 8,516,938.69                                  |
| 其他利息收入                     |          | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 27,506,863.95                            | 28,091,687.49                                 |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.10 | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.11 | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.12 | 27,506,863.95                            | 28,091,687.49                                 |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.13 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.14 | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.15 | -                                        | -                                             |
| 股利收益                       | 6.4.7.16 | -                                        | -                                             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.17 | -                                        | -                                             |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.18 | -                                        | -                                             |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | <b>13,428,719.33</b>                     | <b>17,507,598.17</b>                          |
| 1. 管理人报酬                   |          | <b>6,705,280.74</b>                      | <b>8,252,253.53</b>                           |
| 其中：暂估管理人报酬（若有）             |          | -                                        | -                                             |
| 2. 托管费                     |          | 2,031,903.18                             | 2,500,682.82                                  |
| 3. 销售服务费                   |          | 3,920,252.59                             | 4,703,609.38                                  |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                                        | -                                             |
| 5. 利息支出                    |          | 620,538.68                               | 1,876,903.69                                  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 620,538.68                               | 1,876,903.69                                  |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.19 | -                                        | -                                             |
| 7. 税金及附加                   |          | 11,873.85                                | 20,260.39                                     |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.20 | 138,870.29                               | 153,888.36                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>23,668,634.72</b>                     | <b>42,975,226.60</b>                          |
| 减：所得税费用                    |          | -                                        | -                                             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>23,668,634.72</b>                     | <b>42,975,226.60</b>                          |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | <b>-</b>                                 | <b>-</b>                                      |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>23,668,634.72</b>                     | <b>42,975,226.60</b>                          |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：新华壹诺宝货币市场基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日      |                |                |                    |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|----------------|--------------------|
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合<br>收益（若有） | 未分配利润          | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                                | 6,133,687,416.36                           | -              | -              | 6,133,687,416.36   |
| 二、本期期初净资产                                | 6,133,687,416.36                           | -              | -              | 6,133,687,416.36   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -2,790,996,071.43                          | -              | 0.00           | -2,790,996,071.43  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | -              | 23,668,634.72  | 23,668,634.72      |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -2,790,996,071.43                          | -              | -              | -2,790,996,071.43  |
| 其中：1.基金申购款                               | 17,087,771,919.59                          | -              | -              | 17,087,771,919.59  |
| 2.基金赎回款                                  | -19,878,767,991.02                         | -              | -              | -19,878,767,991.02 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                          | -              | -23,668,634.72 | -23,668,634.72     |
| 四、本期期末净资产                                | 3,342,691,344.93                           | -              | -              | 3,342,691,344.93   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                |                |                    |
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合<br>收益（若有） | 未分配利润          | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                                | 4,442,361,418.38                           | -              | -              | 4,442,361,418.38   |
| 二、本期期初净资产                                | 4,442,361,418.38                           | -              | -              | 4,442,361,418.38   |

|                                          |                    |   |                |                    |
|------------------------------------------|--------------------|---|----------------|--------------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 1,319,576,299.21   | - | 0.00           | 1,319,576,299.21   |
| （一）、综合收益总额                               | -                  | - | 42,975,226.60  | 42,975,226.60      |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | 1,319,576,299.21   | - | -              | 1,319,576,299.21   |
| 其中：1.基金申购款                               | 25,676,263,984.05  | - | -              | 25,676,263,984.05  |
| 2.基金赎回款                                  | -24,356,687,684.84 | - | -              | -24,356,687,684.84 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                  | - | -42,975,226.60 | -42,975,226.60     |
| 四、本期期末净资产                                | 5,761,937,717.59   | - | -              | 5,761,937,717.59   |

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：银国宏，主管会计工作负责人：胡三明，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 号文的核准，由新华基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2013 年 12 月 3 日正式生效，首次设立募集规模为 409,018,569.10 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。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。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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》、《新华壹诺宝货币市场基金基金合同》和在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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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本报告期的财务状况、经营成果和净资产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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 76,355,644.13          |
| 等于：本金          | 76,316,814.46          |
| 加：应计利息         | 38,829.67              |
| 定期存款           | 100,017,319.44         |
| 等于：本金          | 100,000,000.00         |
| 加：应计利息         | 17,319.44              |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 50,015,000.00          |
| 存款期限 1-3 个月    | 50,002,319.44          |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 合计             | 176,372,963.57         |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |                  |            |        |
|--------|-------|------------------------|------------------|------------|--------|
|        |       | 按实际利率计算的<br>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 | 2,372,540,368.60       | 2,373,170,620.81 | 630,252.21 | 0.0189 |
|        | 合计    | 2,372,540,368.60       | 2,373,170,620.81 | 630,252.21 | 0.0189 |
| 资产支持证券 |       | -                      | -                | -          | -      |
| 合计     |       | 2,372,540,368.60       | 2,373,170,620.81 | 630,252.21 | 0.0189 |

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

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末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<br>2025 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 | 710,209,727.10         | -         |
| 合计    | 710,209,727.10         | -         |

##### 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|             | 2025 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   | -               |
| 应付交易费用      | 29,304.16       |
| 其中：交易所市场    | -               |
| 银行间市场       | 29,304.16       |
| 应付利息        | -               |
| 应付账户维护费     | 9,000.00        |
| 应付证券时报      | 59,507.37       |
| 应付审计费       | 19,835.79       |
| 合计          | 117,647.32      |

#### 6.4.7.7 实收基金

新华壹诺宝 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |                    |
|---------------|----------------------|--------------------|
|               | 2025年1月1日至2025年6月30日 |                    |
|               | 基金份额（份）              | 账面金额               |
| 上年度末          | 4,514,512,799.22     | 4,514,512,799.22   |
| 本期申购          | 11,931,685,345.74    | 11,931,685,345.74  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -14,110,585,023.50   | -14,110,585,023.50 |
| 本期末           | 2,335,613,121.46     | 2,335,613,121.46   |

新华壹诺宝 B

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |                   |
|---------------|----------------------|-------------------|
|               | 2025年1月1日至2025年6月30日 |                   |
|               | 基金份额（份）              | 账面金额              |
| 上年度末          | 1,618,783,926.83     | 1,618,783,926.83  |
| 本期申购          | 5,156,084,397.20     | 5,156,084,397.20  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,767,959,067.28    | -5,767,959,067.28 |
| 本期末           | 1,006,909,256.75     | 1,006,909,256.75  |

新华壹诺宝 E

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |             |
|---------------|----------------------|-------------|
|               | 2025年1月1日至2025年6月30日 |             |
|               | 基金份额（份）              | 账面金额        |
| 上年度末          | 390,690.31           | 390,690.31  |
| 本期申购          | 2,176.65             | 2,176.65    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -223,900.24          | -223,900.24 |
| 本期末           | 168,966.72           | 168,966.72  |

注：申购含红利再投，转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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           | 17,536,917.67  | -     | 17,536,917.67  |
| 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        | -17,536,917.67 | -     | -17,536,917.67 |
| 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           | 6,129,550.32  | -     | 6,129,550.32  |
| 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        | -6,129,550.32 | -     | -6,129,550.32 |
| 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           | 2,166.73  | - | 2,166.73  |
| 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        | -2,166.73 | - | -2,166.73 |
| 本期末            | 0.00      | - | 0.00      |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 905,244.58                            |
| 定期存款利息收入  | 4,612,416.07                          |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 2.12                                  |
| 其他        | 2,676.50                              |
| 合计        | 5,520,339.27                          |

注：本项结算备付金利息收入包含保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 26,994,449.32              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 512,414.63                 |
| 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                           | 27,506,863.95              |

**6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 5,185,229,966.27           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 5,177,970,497.38           |
| 减：应计利息总额               | 6,747,054.26               |
| 减：交易费用                 | -                          |
| 买卖债券差价收入               | 512,414.63                 |

**6.4.7.13 资产支持证券投资收益****6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.18 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.19 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 19,835.79                  |
| 信息披露费    | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金  | -                          |
| 银行汇划费    | 40,927.13                  |
| 上清所证书使用费 | 600.00                     |
| 账户维护费    | 18,000.00                  |
| 合计       | 138,870.29                 |

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准日，本基金无需要披露的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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 恒泰证券股份有限公司     | 基金管理人股东、基金销售机构      |
| 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         |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 6,705,280.74               | 8,252,253.53                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 2,751,704.43               | 3,336,599.84                    |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 3,953,576.31               | 4,915,653.69                    |

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，每日计提，按月支付。

其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数；

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,031,903.18               | 2,500,682.82                    |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.10%的年费率计提，每日计提，按月支付。

其计算公式为：每日应计提的基金托管费=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<br>2025年1月1日至2025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   | 33,153.32                       | 16.86     | -       | 33,170.18  |
| 新华基金管理股份有限公司   | 31,771.86                       | 25,682.33 | -       | 57,454.19  |
| 恒泰证券股份有限公司     | 469,270.85                      | -         | -       | 469,270.85 |
| 合计             | 534,196.03                      | 25,699.19 | -       | 559,895.22 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024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   | 35,988.72                       | 32.92     | -       | 36,021.64  |
| 新华基金管理股份有限公司   | 31,328.41                       | 33,316.97 | -       | 64,645.38  |
| 恒泰证券股份有限公司     | 400,920.05                      | -         | -       | 400,920.05 |
| 合计             | 468,237.18                      | 33,349.89 | -       | 501,587.07 |

注：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 24 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，2024 年 12 月 25 日至 2025 年 1 月 2 日基金 A 类销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 年费率计提基金 A 类销售服务费，2025 年 1 月 3 日起基金 A 类销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提基金 A 类销售服务费，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，每日计提，按月支付；

其计算公式为：基金 A 类每日应计提的基金销售服务费=前一日 A 类基金资产净值×年费率/当年天数，B 类每日应计提的基金销售服务费=前一日 B 类基金资产净值×年费率/当年天数，E 类每日应计提的基金销售服务费=前一日 E 类基金资产净值×年费率/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率

的证券出借业务。

#### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |                |        |
|---------------------------------|----------------------------|----------------|--------|
|                                 | 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                       | -                          | 280,000,000.00 | -      |
| 期间申购/买入总份额                      | -                          | 946,277.37     | -      |
| 期间因拆分变动份额                       | -                          | -              | -      |
| 减：期间赎回/卖出总份额                    | -                          | 280,946,277.37 | -      |
| 期末持有的基金份额                       | -                          | 0.00           | -      |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例               | -                          | 0.00%          | -      |

注：1、报告期期间买入/申购总份额为货币基金收益结转份额 946277.37 份。

2、对于分级基金，下属分级份额占比的分母采用各自级别的份额。

##### 6.4.10.5.2 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 A

份额单位：份

| 关联方名称          | 新华壹诺宝A本期末<br>2025年6月30日 |                          | 新华壹诺宝A上年度末<br>2024年12月31日 |                      |
|----------------|-------------------------|--------------------------|---------------------------|----------------------|
|                | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额               | 持有的基金份额占<br>基金总份额的比例 |
| 北京新华富时资产管理有限公司 | 9,789.30                | 0.00%                    | 9,734.66                  | 0.00%                |

注：对于分级基金，下属分级份额占比的分母采用各自级别的份额。

#### 6.4.10.6 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024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 | 76,355,644.13              | 905,244.58 | 515,984,457.78                  | 2,503,033.52 |

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分<br>配合计  | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 17,655,715.20    | -                 | -118,797.53  | 17,536,917.67 | -  |

##### 2、新华壹诺宝 B

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分<br>配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 6,160,284.03     | -                 | -30,733.71   | 6,129,550.32 | -  |

##### 3、新华壹诺宝 E

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分<br>配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 2,176.65         | -                 | -9.92        | 2,166.73     | -  |

#### 6.4.12 期末（2025 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券产生的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末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

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

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.12.4 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。

### 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下设的审计委员会为核心的、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投资备选库制度、交易对手库管理和分散化投资方式防范信用风险。

##### 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<br>2025年6月30日 | 上年末<br>2024年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | -                 | -                  |
| A-1 以下 | -                 | -                  |

|     |               |   |
|-----|---------------|---|
| 未评级 | 50,960,951.63 | - |
| 合计  | 50,960,951.63 | - |

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

3.上年末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年末，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

本期末及上年末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 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<br>2025年6月30日 | 上年末<br>2024年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 280,376,336.73    | 540,516,423.96     |
| AAA 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | 50,200,141.40     | -                  |
| 合计     | 330,576,478.13    | 540,516,423.96     |

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 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<br>2025年6月30日 | 上年末<br>2024年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 1,911,231,539.18  | 2,695,348,026.90   |
| AAA 以下 | 79,771,399.66     | 49,798,460.14      |
| 未评级    | -                 | -                  |
| 合计     | 1,991,002,938.84  | 2,745,146,487.04   |

#### 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<br>2025 年 6 月<br>30 日 | 1 年以内            | 1-5 年         | 5 年以上 | 不计息 | 合计               |
|---------------------------|------------------|---------------|-------|-----|------------------|
| 资产                        |                  |               |       |     |                  |
| 货币资金                      | 176,372,963.57   | -             | -     | -   | 176,372,963.57   |
| 结算备付金                     | -                | -             | -     | -   | -                |
| 存出保证金                     | 946.30           | -             | -     | -   | 946.30           |
| 交易性金融<br>资产               | 2,312,298,776.24 | 60,241,592.36 | -     | -   | 2,372,540,368.60 |
| 衍生金融资<br>产                | -                | -             | -     | -   | -                |
| 买入返售金<br>融资产              | 710,209,727.10   | -             | -     | -   | 710,209,727.10   |

|                             |                  |               |       |               |                  |
|-----------------------------|------------------|---------------|-------|---------------|------------------|
| 债权投资                        | -                | -             | -     | -             | -                |
| 其他债权投资                      | -                | -             | -     | -             | -                |
| 其他权益工具投资                    | -                | -             | -     | -             | -                |
| 应收清算款                       | -                | -             | -     | 50,046,027.40 | 50,046,027.40    |
| 应收股利                        | -                | -             | -     | -             | -                |
| 应收申购款                       | -                | -             | -     | 35,318,341.94 | 35,318,341.94    |
| 递延所得税资产                     | -                | -             | -     | -             | -                |
| 其他资产                        | -                | -             | -     | -             | -                |
| 资产总计                        | 3,198,882,413.21 | 60,241,592.36 | 0.00  | 85,364,369.34 | 3,344,488,374.91 |
| 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                   | -                | -             | -     | -             | -                |
| 应付清算款                       | -                | -             | -     | -             | -                |
| 应付赎回款                       | -                | -             | -     | -             | -                |
| 应付管理人报酬                     | -                | -             | -     | 810,664.51    | 810,664.51       |
| 应付托管费                       | -                | -             | -     | 245,655.91    | 245,655.91       |
| 应付销售服务费                     | -                | -             | -     | 496,205.33    | 496,205.33       |
| 应付投资顾问费                     | -                | -             | -     | -             | -                |
| 应交税费                        | -                | -             | -     | 16,743.49     | 16,743.49        |
| 应付利润                        | -                | -             | -     | 110,113.42    | 110,113.42       |
| 递延所得税负债                     | -                | -             | -     | -             | -                |
| 其他负债                        | -                | -             | -     | 117,647.32    | 117,647.32       |
| 负债总计                        | -                | -             | -     | 1,797,029.98  | 1,797,029.98     |
| 利率敏感缺口                      | 3,198,882,413.21 | 60,241,592.36 | -     | 83,567,339.36 | 3,342,691,344.93 |
| 上年度末<br>2024 年 12 月<br>31 日 | 1 年以内            | 1-5 年         | 5 年以上 | 不计息           | 合计               |
| 资产                          |                  |               |       |               |                  |
| 货币资金                        | 1,281,057,834.53 | -             | -     | -             | 1,281,057,834.53 |

|           |                  |   |   |                |                  |
|-----------|------------------|---|---|----------------|------------------|
| 结算备付金     | -                | - | - | -              | -                |
| 存出保证金     | 1,528.16         | - | - | -              | 1,528.16         |
| 交易性金融资产   | 3,285,662,911.00 | - | - | -              | 3,285,662,911.00 |
| 衍生金融资产    | -                | - | - | -              | -                |
| 买入返售金融资产  | 1,352,192,729.62 | - | - | -              | 1,352,192,729.62 |
| 债权投资      | -                | - | - | -              | -                |
| 其他债权投资    | -                | - | - | -              | -                |
| 其他权益工具投资  | -                | - | - | -              | -                |
| 应收清算款     | -                | - | - | -              | -                |
| 应收股利      | -                | - | - | -              | -                |
| 应收申购款     | -                | - | - | 217,140,626.33 | 217,140,626.33   |
| 递延所得税资产   | -                | - | - | -              | -                |
| 其他资产      | -                | - | - | -              | -                |
| 资产总计      | 5,918,915,003.31 | - | - | 217,140,626.33 | 6,136,055,629.64 |
| 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 | -                | - | - | -              | -                |
| 应付清算款     | -                | - | - | -              | -                |
| 应付赎回款     | -                | - | - | -              | -                |
| 应付管理人报酬   | -                | - | - | 1,055,451.61   | 1,055,451.61     |
| 应付托管费     | -                | - | - | 319,833.78     | 319,833.78       |
| 应付销售服务费   | -                | - | - | 476,417.59     | 476,417.59       |
| 应付投资顾问费   | -                | - | - | -              | -                |
| 应交税费      | -                | - | - | 33,908.13      | 33,908.13        |
| 应付利润      | -                | - | - | 259,654.58     | 259,654.58       |
| 递延所得税负债   | -                | - | - | -              | -                |
| 其他负债      | -                | - | - | 222,947.59     | 222,947.59       |
| 负债总计      | -                | - | - | 2,368,213.28   | 2,368,213.28     |

|             |                  |   |   |                |                  |
|-------------|------------------|---|---|----------------|------------------|
| 利率敏感度<br>缺口 | 5,918,915,003.31 | - | - | 214,772,413.05 | 6,133,687,416.36 |
|-------------|------------------|---|---|----------------|------------------|

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

| 假设 | 其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点 |                                 |                          |
|----|---------------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                 | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                           | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率上升 25.00 bp           | -1,664,112.66                   | -1,723,470.12            |
|    | 市场利率下降 25.00 bp           | 1,666,977.76                    | 1,725,841.50             |

#### 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。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 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 |
|---------------|-----|

|      | 2025 年 6 月 30 日  |
|------|------------------|
| 第一层次 | -                |
| 第二层次 | 2,372,540,368.60 |
| 第三层次 | -                |
| 合计   | 2,372,540,368.60 |

#### 6.4.14.2 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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 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<br>(%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1  | 固定收益投资            | 2,372,540,368.60 | 70.94            |
|    | 其中：债券             | 2,372,540,368.60 | 70.94            |
|    | 资产支持证券            | -                | -                |
| 2  | 买入返售金融资产          | 710,209,727.10   | 21.24            |
|    | 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 | 176,372,963.57   | 5.27   |
| 4 | 其他各项资产       | 85,365,315.64    | 2.55   |
| 5 | 合计           | 3,344,488,374.91 | 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 | 2.11          |               |
|    | 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 | -             | -             |
|    | 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

本基金本报告期债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 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    | 76 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 82 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 43 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内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                 | 26.52              | 0.00               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 10.15              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 34.58              | -                  |

|    |                            |       |      |
|----|----------------------------|-------|------|
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -     | -    |
| 4  | 90 天（含）—120 天              | 8.06  | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -     | -    |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）          | 19.64 | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -     | -    |
| 合计 |                            | 98.95 | 0.00 |

#### 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

本基金本报告期内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                 | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券                 | -                | -            |
| 2  | 央行票据                 | -                | -            |
| 3  | 金融债券                 | 101,161,093.03   | 3.03         |
|    | 其中：政策性金融债            | 101,161,093.03   | 3.03         |
| 4  | 企业债券                 | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 280,376,336.73   | 8.39         |
| 6  | 中期票据                 | -                | -            |
| 7  | 同业存单                 | 1,991,002,938.84 | 59.56        |
| 8  | 其他                   | -                | -            |
| 9  | 合计                   | 2,372,540,368.60 | 70.98        |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -            |

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值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)      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|----------------|--------------|
| 1  | 012581312 | 25 华能集 SCP006 | 1,000,000.00 | 100,037,083.71 | 2.99         |

|    |           |               |              |               |      |
|----|-----------|---------------|--------------|---------------|------|
| 2  | 112520022 | 25 广发银行 CD022 | 1,000,000.00 | 99,828,865.34 | 2.99 |
| 3  | 112520129 | 25 广发银行 CD129 | 1,000,000.00 | 99,741,826.98 | 2.98 |
| 4  | 112522020 | 25 邮储银行 CD020 | 1,000,000.00 | 99,680,883.33 | 2.98 |
| 5  | 112518176 | 25 华夏银行 CD176 | 1,000,000.00 | 99,622,111.00 | 2.98 |
| 6  | 112406286 | 24 交通银行 CD286 | 1,000,000.00 | 99,596,645.45 | 2.98 |
| 7  | 112503205 | 25 农业银行 CD205 | 1,000,000.00 | 99,595,238.81 | 2.98 |
| 8  | 112503102 | 25 农业银行 CD102 | 1,000,000.00 | 99,551,588.22 | 2.98 |
| 9  | 112403238 | 24 农业银行 CD238 | 1,000,000.00 | 99,546,369.88 | 2.98 |
| 10 | 112503107 | 25 农业银行 CD107 | 1,000,000.00 | 99,543,221.85 | 2.98 |

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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                   | 0.0562%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0414% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0255%  |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金报告期内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

本基金报告期内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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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”，即计价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，在剩余存续期内按实际利率法摊销，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“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值负偏离度的绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%

时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5% 以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5% 时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

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 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 | 946.30        |
| 2  | 应收清算款 | 50,046,027.40 |
| 3  | 应收利息  | -             |
| 4  | 应收申购款 | 35,318,341.94 |
| 5  | 其他应收款 | -             |
| 6  | 待摊费用  | -             |
| 7  | 其他    | -             |
| 8  | 合计    | 85,365,315.64 |

### 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             | 占总份额比例 | 持有份额             | 占总份额比例  |
| 新华壹诺宝 A | 586,774  | 3,980.43      | 117,014,521.54   | 5.01%  | 2,218,598,599.92 | 94.99%  |
| 新华壹诺宝 B | 42       | 23,974,029.92 | 975,818,691.03   | 96.91% | 31,090,565.72    | 3.09%   |
| 新华壹诺宝 E | 11       | 15,360.61     | 0.00             | 0.00%  | 168,966.72       | 100.00% |
| 合计      | 586,827  | 5,696.21      | 1,092,833,212.57 | 32.69% | 2,249,858,132.36 | 67.31%  |

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  | 保险类机构 | 200,019,607.32 | 5.98%  |
| 2  | 券商类机构 | 100,740,908.96 | 3.01%  |
| 3  | 其他机构  | 59,209,557.92  | 1.77%  |
| 4  | 券商类机构 | 50,008,281.96  | 1.50%  |
| 5  | 信托类机构 | 50,006,618.84  | 1.50%  |
| 6  | 其他机构  | 44,840,298.32  | 1.34%  |
| 7  | 其他机构  | 43,497,201.52  | 1.30%  |
| 8  | 券商类机构 | 36,010,923.69  | 1.08%  |
| 9  | 其他机构  | 30,191,520.72  | 0.90%  |
| 10 | 基金类机构 | 25,000,000.00  | 0.75%  |

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 | 新华壹诺宝 A | 109,750.49 | 0.00%    |
|            | 新华壹诺宝 B | 0.00       | 0.00%    |

|        |         |            |       |
|--------|---------|------------|-------|
| 员持有本基金 | 新华壹诺宝 E | 0.00       | 0.00% |
|        | 合计      | 109,750.49 | 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                 |

### 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                   | 4,514,512,799.22  | 1,618,783,926.83 | 390,690.31 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 11,931,685,345.74 | 5,156,084,397.20 | 2,176.65   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 14,110,585,023.50 | 5,767,959,067.28 | 223,900.24 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                 | -                | -          |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 2,335,613,121.46  | 1,006,909,256.75 | 168,966.72 |

### 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

基金管理人于 2025 年 1 月 25 日发布公告，自 2025 年 1 月 23 日起胡三明先生担任公司总经理，杨金亮先生离任公司总经理；自 2025 年 1 月 23 日起崔凤廷先生不再担任公司副总经理兼董事会秘书。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领

域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末有涉及基金管理人、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

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

### 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

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚的情况。

### 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      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华安证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 太平洋证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 恒泰证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东吴证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 银河证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 广发证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国投证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：一、交易单元的选择标准：

（一）基本情况：财务状况良好，财务指标符合证券公司监管要求；

（二）合规风控：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；

（三）研究服务实力方面需满足以下条件：1、有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；2、能根据公司所管理基金的特定要求，提供专题研究报告；3、具备较强的服务意识，能主动为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

（四）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。

二、交易单元的选择程序：

（一）公司研究部根据上述标准考察后确定合作的证券公司名单。

（二）公司与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、本基金管理人已根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）及证券业协会测算结果完成佣金调整工作。本部分数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金。

#### 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  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 华创证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 华安证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国信证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 太平洋证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 恒泰证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东吴证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国金证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 申万宏源  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 银河证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东北证券  | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | - | - | - | - | - | - |

#### 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旗下基金 2024 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、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025-01-22 |
| 2  | 新华壹诺宝货币市场基金 2024 年第 4 季度报告                   | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2025-01-22 |
| 3  | 新华基金管理股份有限公司新华壹诺宝货币市场基金暂停申购、定期定额投资和转换转入业务的公告 | 证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                  | 2025-01-23 |
| 4  | 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（副总经理、董事会秘书）       | 中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                 | 2025-01-25 |
| 5  | 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（总经理）              | 中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                 | 2025-01-25 |
| 6  | 新华基金管理股份有限公司新华壹诺宝货币市场基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告 | 证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                  | 2025-03-12 |
| 7  | 新华基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况          | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2025-03-31 |
| 8  | 新华基金管理股份有限公司旗下基金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、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025-03-31 |
| 9  | 新华壹诺宝货币市场基金 2024 年年度报告                       | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2025-03-31 |
| 10 | 新华壹诺宝货币市场基金 2025 年第 1 季度报告                   | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2025-04-22 |
| 11 | 新华基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年 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、管理人网站、中国证监会         | 2025-04-22 |

|    |                                         |                                           |            |
|----|-----------------------------------------|-------------------------------------------|------------|
|    |                                         | 基金电子披露网站                                  |            |
| 12 | 新华基金管理股份有限公司关于民商基金销售（上海）有限公司终止代销旗下基金的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025-06-04 |

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 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）中国证监会准予新华壹诺宝货币市场基金注册的文件
- （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）《新华壹诺宝货币市场基金招募说明书》（更新）
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照

### 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

二〇二五年八月二十八日