# 诺安天天宝货币市场基金

# 2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 基金简称 | 诺安天天宝货币 | | | |
| 基金主代码 | 000559 | | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | | |
| 基金合同生效日 | 2014 年 03 月 25 日 | | | |
| 报告期末基金份额总额 | 95,702,284,797.76 份 | | | |
| 投资目标 | 在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。 | | | |
| 投资策略 | 本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。 | | | |
| 业绩比较基准 | 活期存款利率（税后） | | | |
| 风险收益特征 | 本基金属于货币市场基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。 | | | |
| 基金管理人 | 诺安基金管理有限公司 | | | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 诺安天天宝货币 A | 诺安天天宝货币 B | 诺安天天宝货币 C | 诺安天天宝货币 E |
| 下属分级基金的交易代码 | 000559 | 000625 | 000818 | 000560 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 95,537,735,341.71 份 | 23,271,519.01 份 | 2,061,433.33 份 | 139,216,503.71 份 |

注：自 2014 年 4 月 28 日起，本基金增加 B 类基金份额；自 2014 年 9 月 24 日起，本基金增加 C 类基金份额，分设 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额。

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日） | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 诺安天天宝货币 A | 诺安天天宝货币 B | 诺安天天宝货币 C | 诺安天天宝货币 E |
| 1.本期已实现收益 | 203,025,833.36 | 60,806.77 | 4,610.92 | 362,947.47 |
| 2.本期利润 | 203,025,833.36 | 60,806.77 | 4,610.92 | 362,947.47 |
| 3.期末基金资产净值 | 95,537,735,341.71 | 23,271,519.01 | 2,061,433.33 | 139,216,503.71 |

注：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。本基金按照实际利率法计算账面价值，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。

## 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

诺安天天宝货币 A

| 阶段 | 净值收益率① | 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 | 0.2081% | 0.0001% | 0.0882% | 0.0000% | 0.1199% | 0.0001% |
| 过去六个月 | 0.4399% | 0.0003% | 0.1755% | 0.0000% | 0.2644% | 0.0003% |
| 过去一年 | 0.9476% | 0.0003% | 0.3524% | 0.0000% | 0.5952% | 0.0003% |
| 过去三年 | 4.0017% | 0.0012% | 1.0631% | 0.0000% | 2.9386% | 0.0012% |
| 过去五年 | 8.0378% | 0.0013% | 1.7729% | 0.0000% | 6.2649% | 0.0013% |
| 过去七年 | 12.6217% | 0.0013% | 2.4836% | 0.0000% | 10.1381% | 0.0013% |
| 过去十年 | 23.9793% | 0.0026% | 3.5481% | 0.0000% | 20.4312% | 0.0026% |
| 自基金合同生效起至今 | 34.1293% | 0.0044% | 4.4436% | 0.0000% | 29.6857% | 0.0044% |

诺安天天宝货币 B

| 阶段 | 净值收益率① | 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 | 0.2459% | 0.0001% | 0.0882% | 0.0000% | 0.1577% | 0.0001% |
| 过去六个月 | 0.5154% | 0.0003% | 0.1755% | 0.0000% | 0.3399% | 0.0003% |
| 过去一年 | 1.0890% | 0.0004% | 0.3524% | 0.0000% | 0.7366% | 0.0004% |
| 过去三年 | 4.4379% | 0.0012% | 1.0631% | 0.0000% | 3.3748% | 0.0012% |
| 过去五年 | 8.8129% | 0.0013% | 1.7729% | 0.0000% | 7.0400% | 0.0013% |
| 过去七年 | 13.7696% | 0.0014% | 2.4836% | 0.0000% | 11.2860% | 0.0014% |
| 过去十年 | 26.0308% | 0.0026% | 3.5481% | 0.0000% | 22.4827% | 0.0026% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.6343% | 0.0045% | 4.4105% | 0.0000% | 33.2238% | 0.0045% |

诺安天天宝货币 C

| 阶段 | 净值收益率① | 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 | 0.2207% | 0.0001% | 0.0882% | 0.0000% | 0.1325% | 0.0001% |
| 过去六个月 | 0.4650% | 0.0003% | 0.1755% | 0.0000% | 0.2895% | 0.0003% |
| 过去一年 | 0.9954% | 0.0003% | 0.3524% | 0.0000% | 0.6430% | 0.0003% |
| 过去三年 | 4.1495% | 0.0012% | 1.0631% | 0.0000% | 3.0864% | 0.0012% |
| 过去五年 | 8.3038% | 0.0013% | 1.7729% | 0.0000% | 6.5309% | 0.0013% |
| 过去七年 | 13.0111% | 0.0013% | 2.4836% | 0.0000% | 10.5275% | 0.0013% |
| 过去十年 | 24.5837% | 0.0026% | 3.5481% | 0.0000% | 21.0356% | 0.0026% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.2415% | 0.0043% | 4.2656% | 0.0000% | 27.9759% | 0.0043% |

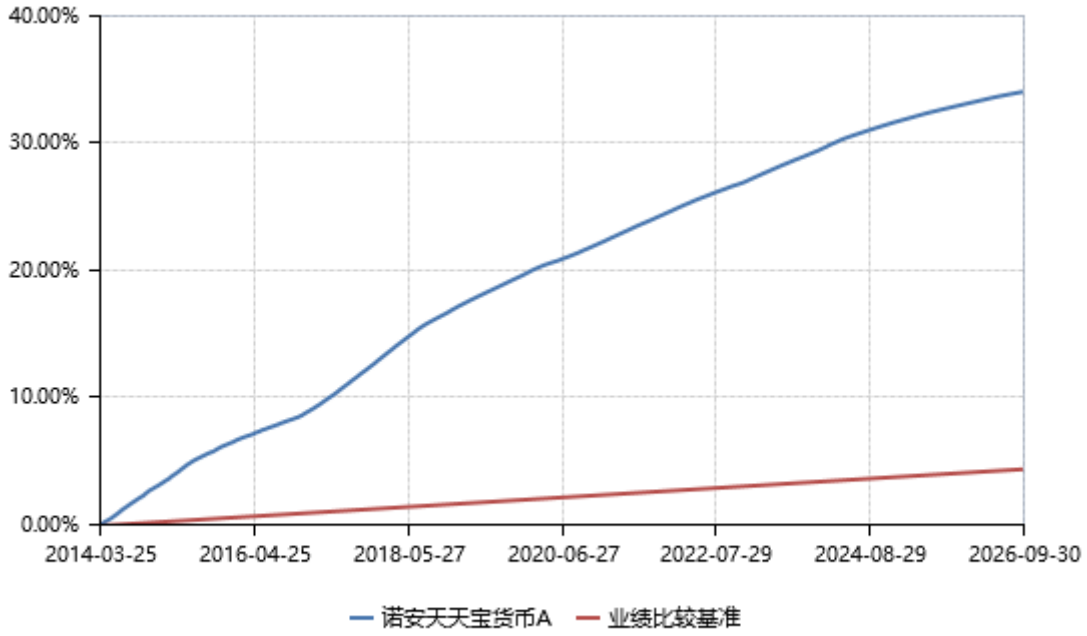
诺安天天宝货币 E

| 阶段 | 净值收益率① | 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 | 0.2459% | 0.0001% | 0.0882% | 0.0000% | 0.1577% | 0.0001% |
| 过去六个月 | 0.5154% | 0.0003% | 0.1755% | 0.0000% | 0.3399% | 0.0003% |
| 过去一年 | 1.0965% | 0.0003% | 0.3524% | 0.0000% | 0.7441% | 0.0003% |
| 过去三年 | 4.4641% | 0.0012% | 1.0631% | 0.0000% | 3.4010% | 0.0012% |
| 过去五年 | 8.8380% | 0.0013% | 1.7729% | 0.0000% | 7.0651% | 0.0013% |
| 过去七年 | 13.7955% | 0.0013% | 2.4836% | 0.0000% | 11.3119% | 0.0013% |
| 过去十年 | 25.9532% | 0.0026% | 3.5481% | 0.0000% | 22.4051% | 0.0026% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.7844% | 0.0044% | 4.4436% | 0.0000% | 32.3408% | 0.0044% |

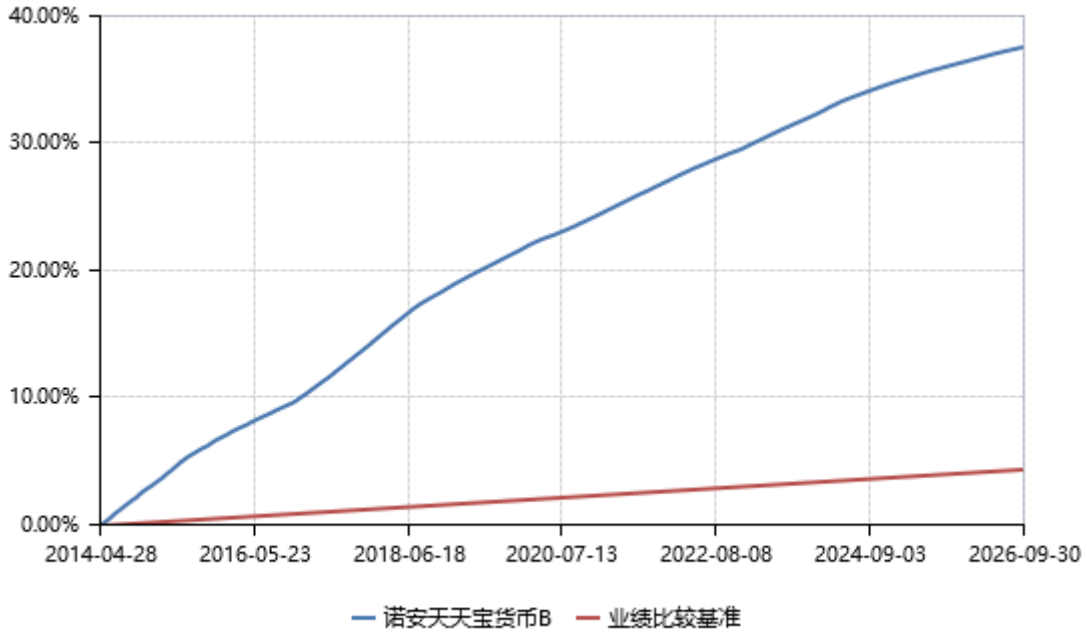
注：本基金的利润分配方式是“每日分配，按日支付”。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

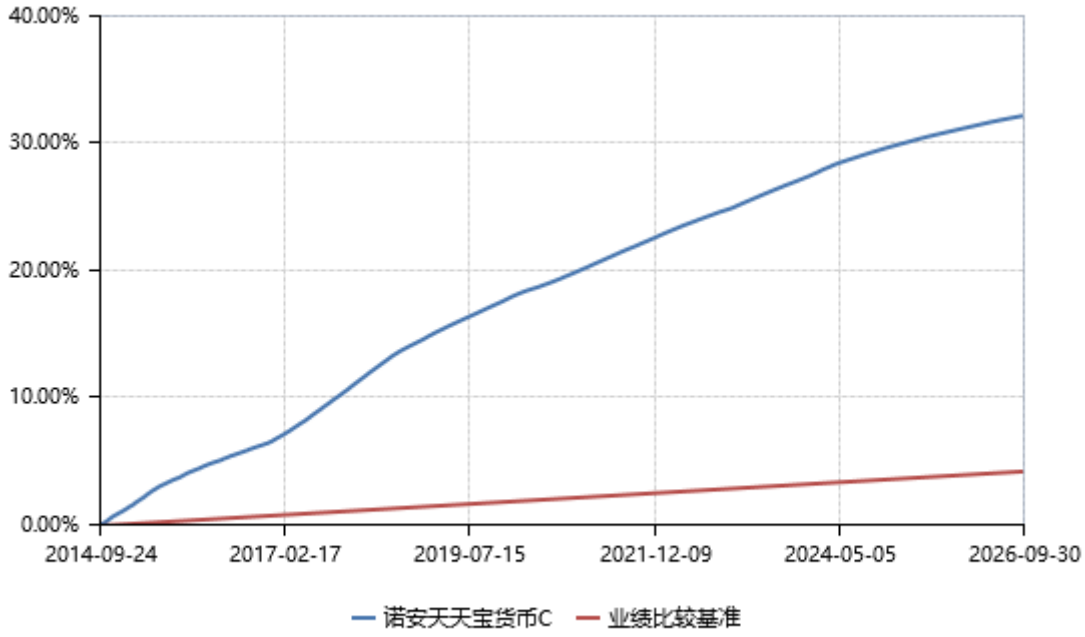
诺安天天宝货币 A



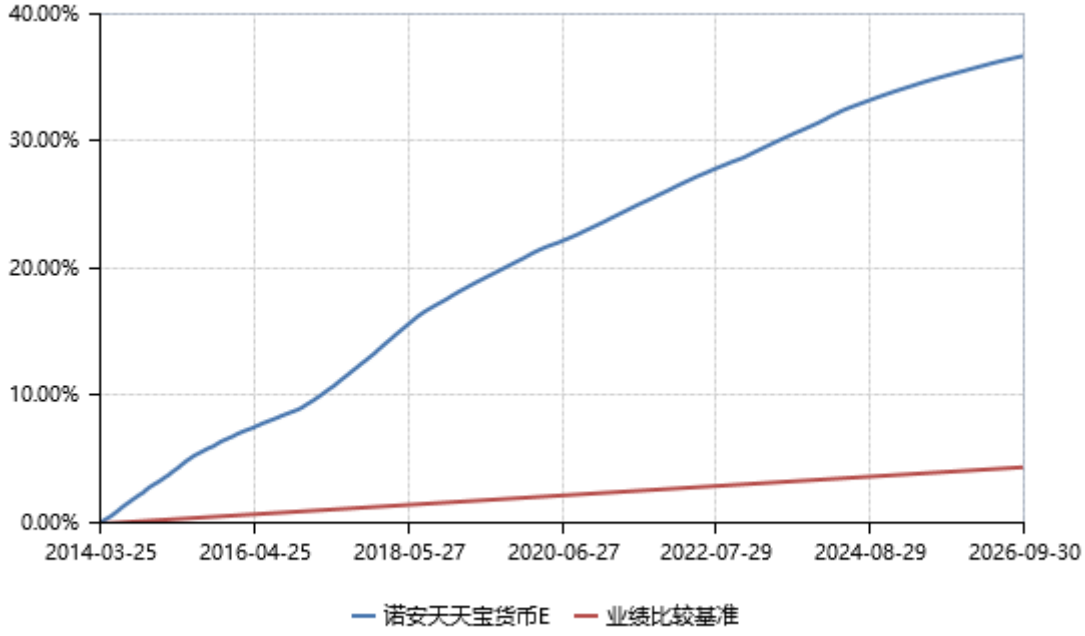

诺安天天宝货币 B




诺安天天宝货币 C




诺安天天宝货币 E




注：本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

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

| | | 任职日期 | 离任日期 | 业年限 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 岳帅 | 本基金基金经理 | 2019 年 10 月 15 日 | - | 16 年 | 硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于红塔证券股份有限公司，任分析师助理；银河期货有限公司，任客户经理；平安利顺货币经纪有限公司，任债券交易员。2013 年 4 月加入诺安基金管理有限公司，历任债券交易员。2017 年 8 月至 2018 年 8 月任诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月起任诺安货币市场基金基金经理，2017 年 8 月起任诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2018 年 9 月起任诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 10 月起任诺安天天宝货币市场基金基金经理，2026 年 3 月起任诺安悦鑫 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理。 |
| 潘飞 | 固定收益事业部副总经理、本基金基金经理 | 2021 年 11 月 13 日 | - | 16 年 | 硕士，CFA，具有基金从业资格。曾就职于广发银行股份有限公司，任投资经理。2015 年 4 月加入诺安基金管理有限公司，历任基金经理助理、固定收益事业部总经理助理，现任固定收益事业部副总经理。2019 年 5 月至 2022 年 2 月任诺安恒惠债券型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月至 2022 年 6 月任诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 理。2016 年 9 月起任诺安理财宝货币市场基金基金经理，2017 年 12 月起任诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 11 月起任诺安天天宝货币市场基金基金经理，2022 年 4 月起任诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 6 月起任诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理。 |

注：①对于首任基金经理，上述“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；对于非首任基金经理，上述“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

②证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期间，本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了基金合同的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决

策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合。对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并下达申购指令；公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5%的情况。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年 3 季度基本面状态依旧偏弱，央行货币政策呵护态度显著，其对资金利率的把控能力得到充分体现，资金价格围绕政策利率附近窄幅波动，债市处于相对有利的宏观环境中，其中资金和机构行为是影响 3 季度债市运行的核心变量。具体来看，7 月资金面并未如预期般宽松，资金价格持续高于政策利率，且在央行大额投放后资金价格并未显著下行，修正了二季度资金价格持续低于政策利率的乐观预期，基本面、通胀和风险偏好等并未对债市波动产生较大影响，资金面的小幅收敛对中短端形成压制小幅上行，中长端则表现偏稳且利差小幅压缩，而超长端则由于交易情绪发酵小幅下行表现偏强；8、9 月资金面整体偏均衡，虽然银行尤其是大行提价吸收负债的需求相对积极，但是在央行呵护下整体预期稳定，债券市场短端表现相对稳定，而其他期限和品种则在各种利好（如供给稳定、摊余债基发行、经济数据表现较弱和货币政策宽松预期再次升温等）催化下机构行为表现积极，催生了信用利差和期限利差持续压缩行情，尤其是超长端则在基本面弹性不足、央行维稳资金面和利差相对较高等背景下催生了一波交易性机会。整体看，

债市 3 季度呈现短端稳定、中长端收益率曲线平坦化特征，信用利差和期限利差持续压缩。

本基金在以流动性管理作为重点的同时努力提高收益，始终坚持“确保本金的安全性、资产的流动性，力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益”的原则，注重信用风险的控制，严格执行内部债券评级制度，确保资产的安全性。在投资管理过程中，注重控制投资、交易及操作风险，对基金资产进行合理配置。

操作上，管理人 2026 年 3 季度整体维持了较高的组合剩余期限，并进一步优化调整了持仓结构。未来管理人将继续在保证资产的流动性和安全性的基础上，秉持债券分散化投资的原则，加强对市场走势的研判和风险评估，通过动态调整持仓结构，平衡风险和收益，争取为投资者创造更安全和有竞争优势的回报。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，诺安天天宝货币 A 份额净值收益率为 0.2081%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%；诺安天天宝货币 B 份额净值收益率为 0.2459%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%；诺安天天宝货币 C 份额净值收益率为 0.2207%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%；诺安天天宝货币 E 份额净值收益率为 0.2459%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 43,141,652,081.93 | 40.99 |
| | 其中：债券 | 43,141,652,081.93 | 40.99 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 16,789,716,105.28 | 15.95 |
| | 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 | 45,328,656,396.80 | 43.06 |
| 4 | 其他资产 | 540,447.35 | 0.00 |
| 5 | 合计 | 105,260,565,031.36 | 100.00 |

### 5.2 报告期债券回购融资情况

| 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 | 2.75 | |
| | 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 | 9,503,186,331.57 | 9.93 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

**债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明**

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 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 | 118 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 119 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 104 |

**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出现投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 5.3.2 报告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 | 28.35 | 9.93 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 2.56 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 19.21 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 16.38 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 43.26 | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 109.75 | 9.93 |

## 5.4 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。

## 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,804,952,201.33 | 2.93 |
| | 其中：政策性金融债 | 2,804,952,201.33 | 2.93 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 6,420,535,192.14 | 6.71 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 33,916,164,688.46 | 35.44 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 43,141,652,081.93 | 45.08 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

## 5.6 报告期末按公允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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 112620050 | 26 广发银行 CD050 | 55,000,000 | 5,479,542,713.72 | 5.73 |
| 2 | 09260401 | 26 农发清发 01 | 22,900,000 | 2,299,592,641.01 | 2.40 |
| 3 | 112605250 | 26 建设银行 CD250 | 21,000,000 | 2,081,371,362.88 | 2.17 |
| 4 | 112694502 | 26 北京农商银行 CD015 | 20,000,000 | 1,998,491,445.07 | 2.09 |
| 5 | 112681311 | 26 中原银行 CD184 | 19,500,000 | 1,921,342,452.84 | 2.01 |
| 6 | 112612055 | 26 北京银行 CD055 | 15,000,000 | 1,498,872,532.85 | 1.57 |
| 7 | 112602104 | 26 工商银行 CD104 | 14,000,000 | 1,390,597,649.41 | 1.45 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 8 | 112694553 | 26 宁波银行 CD118 | 13,000,000 | 1,299,022,737.59 | 1.36 |
| 9 | 112619116 | 26 恒丰银行 CD116 | 10,000,000 | 999,245,647.26 | 1.04 |
| 10 | 112613013 | 26 浙商银行 CD013 | 10,000,000 | 999,101,801.64 | 1.04 |

## 5.7 “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 | 0.0142% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0080% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0103% |

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

本基金本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**

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 基金计价方法说明

本基金按实际利率法计算账面价值，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

### 5.9.2 基金投资前十名证券的发行主体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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，广发银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家外汇管理局广东省分局的行政处罚，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的行政处罚，北京农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局北京监管局、中国人民银行北京市分行的行政处罚，中原银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行河南省分行的行政处罚，北京银行股份有限公司在报告编制日前一

年内受到中国人民银行、国家金融监督管理总局北京监管局的行政处罚，中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的行政处罚，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行宁波市分行的行政处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

截至本报告期末，其余证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
| --- | --- | --- |
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 540,447.35 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 合计 | 540,447.35 |

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 诺安天天宝货币 A | 诺安天天宝货币 B | 诺安天天宝货币 C | 诺安天天宝货币 E |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 报告期期初基金份额总额 | 98,438,663,424.10 | 25,322,658.73 | 2,096,327.86 | 164,990,502.89 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 179,358,214,537.42 | 83,084.78 | 135,106.99 | 65,061,066.05 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 182,259,142,619.81 | 2,134,224.50 | 170,001.52 | 90,835,065.23 |
| 报告期期末基金份额总额 | 95,537,735,341.71 | 23,271,519.01 | 2,061,433.33 | 139,216,503.71 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 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，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

# §9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安天天宝货币市场基金募集的文件。

②《诺安天天宝货币市场基金基金合同》。

③《诺安天天宝货币市场基金托管协议》。

④《诺安天天宝货币市场基金招募说明书》。

⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑥报告期内诺安天天宝货币市场基金在规定媒介上披露的各项公告。

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

## 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日