

# 新华壹诺宝货币市场基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 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：二〇二四年十月二十五日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	新华壹诺宝货币
基金主代码	000434
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 3 日
报告期末基金份额总额	4,877,409,355.96 份
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。		
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		
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	4,288,039,110.27 份	589,170,342.64 份	199,903.05 份

### § 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(2024年7月1日-2024年9月30日)		
	新华壹诺宝 A	新华壹诺宝 B	新华壹诺宝 E
1. 本期已实现收益	10,190,907.43	4,567,105.50	955.00
2. 本期利润	10,190,907.43	4,567,105.50	955.00
3. 期末基金资产净值	4,288,039,110.27	589,170,342.64	199,903.05

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金利润分配是按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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	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	0.3272%	0.0014%	0.3399%	0.0000%	-0.0127%	0.0014%
过去六个月	0.7102%	0.0016%	0.6773%	0.0000%	0.0329%	0.0016%
过去一年	1.6141%	0.0016%	1.3601%	0.0000%	0.2540%	0.0016%
过去三年	5.1117%	0.0022%	4.1340%	0.0000%	0.9777%	0.0022%
过去五年	9.2894%	0.0019%	6.9839%	0.0000%	2.3055%	0.0019%
自基金合同生效起至今	32.1295%	0.0046%	15.7400%	0.0000%	16.3895%	0.0046%

##### 2、新华壹诺宝 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	0.3876%	0.0014%	0.3399%	0.0000%	0.0477%	0.0014%
过去六个月	0.8310%	0.0016%	0.6773%	0.0000%	0.1537%	0.0016%
过去一年	1.8584%	0.0016%	1.3601%	0.0000%	0.4983%	0.0016%
过去三年	5.8702%	0.0022%	4.1340%	0.0000%	1.7362%	0.0022%
过去五年	10.6078%	0.0019%	6.9839%	0.0000%	3.6239%	0.0019%
自基金合同生效起至今	22.3483%	0.0032%	11.3101%	0.0000%	11.0382%	0.0032%

##### 3、新华壹诺宝 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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

				④		
过去三个月	0.3772%	0.0014%	0.3399%	0.0000%	0.0373%	0.0014%
过去六个月	0.8409%	0.0016%	0.6773%	0.0000%	0.1636%	0.0016%
过去一年	1.8510%	0.0016%	1.3601%	0.0000%	0.4909%	0.0016%
过去三年	3.4070%	0.0029%	4.1340%	0.0000%	-0.7270%	0.0029%
自基金合同生效起至今	3.4070%	0.0029%	4.9227%	0.0000%	-1.5157%	0.0029%

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

#### 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2024年9月30日)

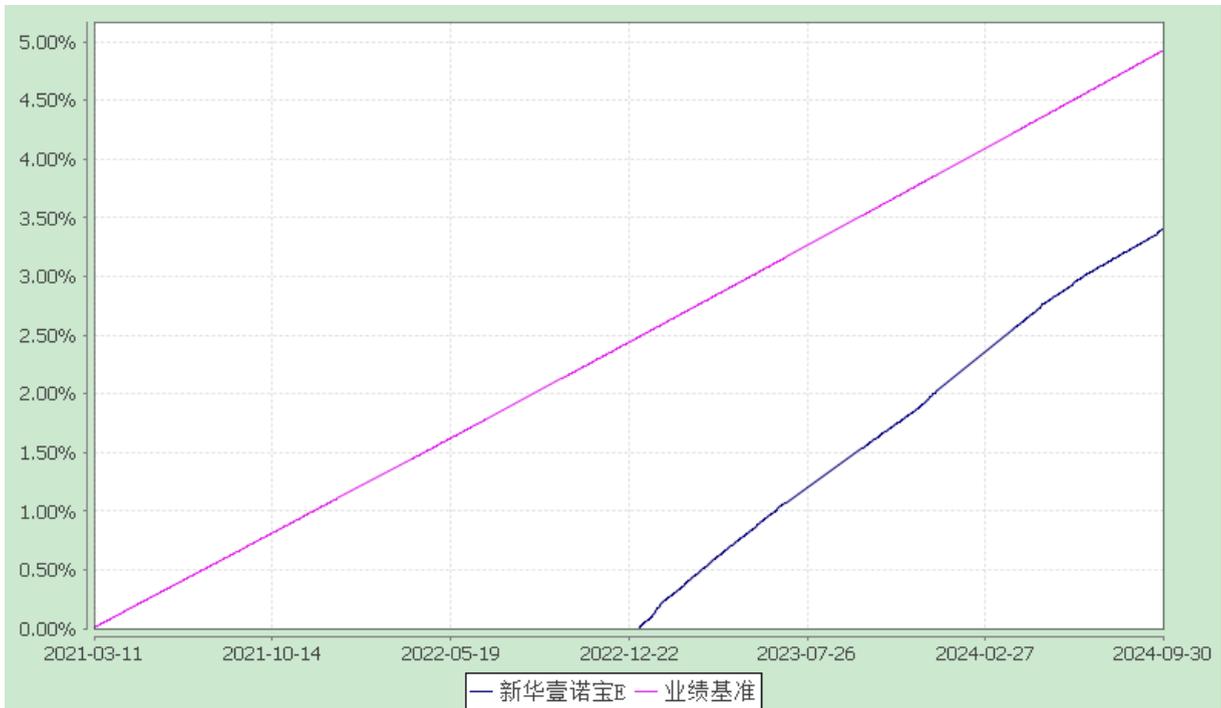
#### 1、新华壹诺宝 A



#### 2、新华壹诺宝 B



### 3、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		证券从业年限	说明
		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	-	12	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。
裴铎	本基金基金经理，新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2022-12-12	-	8	国际关系硕士，曾任广发银行金融市场部交易员、投资经理，新华基金固定收益投资部基金经理助理。

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。

#### 4.2 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規的规定，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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度宏观经济继续呈现转型期特征，外需维持一定韧性，内需待继续提振，生产端表现较好但有所收敛。货币政策方面，本季度降息两次，降准落地，流动性整体维持充裕。财政政策稳增长继续发力，超长期特别国债陆续发行。债券市场表现有所分化，理财赎回，信用债下跌，利率债走势明显强于信用债。银行间资金价格相对平稳，1 年期 AAA 同业存单利率在 1.85%至 2.0%左右区间震荡。

报告期内，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力争为持有人获取较好的投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类（000434）基金份额净值收益率为 0.3272%，同期业绩比较基准收益率为 0.3399%，B 类（003267）基金份额净值收益率为 0.3876%，同期业绩比较基准收益率为 0.3399%，E 类（009099）基金份额净值收益率为 0.3772%，同期业绩比较基准收益率为 0.3399%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	2,031,992,699.98	41.64
	其中：债券	2,031,992,699.98	41.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	774,152,855.48	15.86
	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	2,073,880,626.67	42.50
4	其他资产	1,086.27	0.00
5	合计	4,880,027,268.40	100.00

#### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	5.45
	其中：买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
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

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的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	90
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

### 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	24.43	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	7.17	-

	其中：剩余存续期超过 397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	36.00	-
	其中：剩余存续期超过 397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	6.77	-
	其中：剩余存续期超过 397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天 （含）	25.51	-
	其中：剩余存续期超过 397天的浮动利率债	-	-
合计		99.87	-

#### 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	30,004,839.45	0.62
5	企业短期融资券	452,217,672.71	9.27
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,549,770,187.82	31.77

8	其他	-	-
9	合计	2,031,992,699.98	41.66
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	012481708	24 中国保利 SCP001	1,000,000.00	100,494,533.13	2.06
2	112485759	24 广东南海农商行 CD092	1,000,000.00	99,638,565.19	2.04
3	112403240	24 农业银行 CD240	1,000,000.00	99,568,112.00	2.04
4	112414217	24 江苏银行 CD217	1,000,000.00	99,566,463.73	2.04
5	112486803	24 长沙银行 CD232	1,000,000.00	99,564,690.17	2.04
6	112404026	24 中国银行 CD026	1,000,000.00	99,164,389.66	2.03
7	112486821	24 桂林银行 CD192	1,000,000.00	99,084,133.38	2.03
8	112406286	24 交通银行 CD286	1,000,000.00	98,081,983.55	2.01
9	012482472	24 华能新能 SCP001	700,000.00	70,129,344.62	1.44
10	012480460	24 首钢 SCP001	500,000.00	50,587,852.68	1.04

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.0308%

报告期内偏离度的最低值	0.0066%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0232%

### 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0.50%的情况。

### 5.8 报告期末按摊余成本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

(1) 基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

(2) 基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(3) 基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(4) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

(5) 基金持有的资产支持证券视同债券，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

### 5.9.2 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，广东南海农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局佛山监管分局的处罚；长沙银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局湖南监管局的处罚；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国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚；中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚；桂林银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局桂林监管分局的处罚；交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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。

### 5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,086.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,086.27

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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	新华壹诺宝A	新华壹诺宝B	新华壹诺宝E
本报告期期初基金份额总额	3,741,763,142.34	2,018,853,389.40	1,321,185.85

报告期期间基金总申购份额	5,036,656,535.87	3,802,398,673.97	1,089.60
报告期期间基金总赎回份额	4,490,380,567.94	5,232,081,720.73	1,122,372.40
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	4,288,039,110.27	589,170,342.64	199,903.05

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。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### § 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

本报告期内无单一投资者持有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

本基金本报告期未有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

- （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

## 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到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新华基金管理股份有限公司

二〇二四年十月二十五日