新华壹诺宝货币市场基金

2026 年第 3 季度报告

2026 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：二〇二六年十月二十七日

§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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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	2,163,943,922.43 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	1,692,861,067.24 份	373,963,947.30 份	97,118,907.89 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(2026 年 7 月 1 日-2026 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	5,468,385.18	1,375,578.19	63,046.99
2.本期利润	5,468,385.18	1,375,578.19	63,046.99
3.期末基金资产净值	1,692,861,067.24	373,963,947.30	97,118,907.89

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	0.2454%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	-0.0949%	0.0004%
过去六个月	0.5101%	0.0007%	0.6769%	0.0000%	-0.1668%	0.0007%
过去一年	0.9725%	0.0007%	1.3523%	0.0000%	-0.3798%	0.0007%
过去三年	3.7681%	0.0014%	4.1075%	0.0000%	-0.3394%	0.0014%
过去五年	7.3399%	0.0020%	6.9382%	0.0000%	0.4017%	0.0020%
过去七年	11.6061%	0.0019%	9.8462%	0.0000%	1.7599%	0.0019%
过去十年	22.7603%	0.0032%	14.3572%	0.0000%	8.4031%	0.0032%
自基金合同生效起至今	34.9303%	0.0045%	18.7813%	0.0000%	16.1490%	0.0045%

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	0.3060%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	-0.0343%	0.0004%
过去六个月	0.6310%	0.0007%	0.6769%	0.0000%	-0.0459%	0.0007%
过去一年	1.2152%	0.0007%	1.3523%	0.0000%	-0.1371%	0.0007%
过去三年	4.5129%	0.0014%	4.1075%	0.0000%	0.4054%	0.0014%
过去五年	8.6292%	0.0020%	6.9382%	0.0000%	1.6910%	0.0020%
过去七年	13.4903%	0.0019%	9.8462%	0.0000%	3.6441%	0.0019%
自基金合同生效起至今	25.5368%	0.0032%	14.2608%	0.0000%	11.2760%	0.0032%

3、新华壹诺宝 E:

阶段	净值收益	净值收益	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④

	率①	率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	0.2963%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	-0.0440%	0.0004%
过去六个月	0.6108%	0.0007%	0.6769%	0.0000%	-0.0661%	0.0007%
过去一年	1.1745%	0.0007%	1.3523%	0.0000%	-0.1778%	0.0007%
过去三年	4.4216%	0.0014%	4.1075%	0.0000%	0.3141%	0.0014%
过去五年	6.0169%	0.0023%	6.9382%	0.0000%	-0.9213%	0.0023%
自基金合同生效起至今	6.0169%	0.0024%	7.7429%	0.0000%	-1.7260%	0.0024%

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。

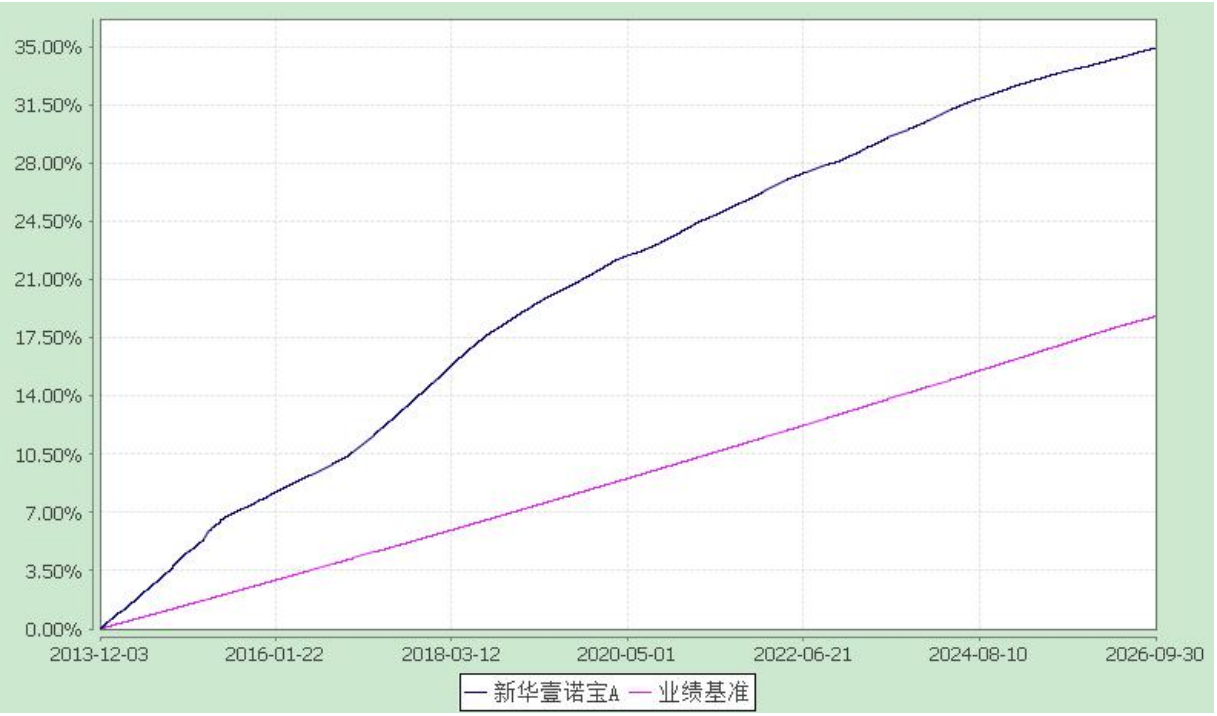
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华壹诺宝货币市场基金

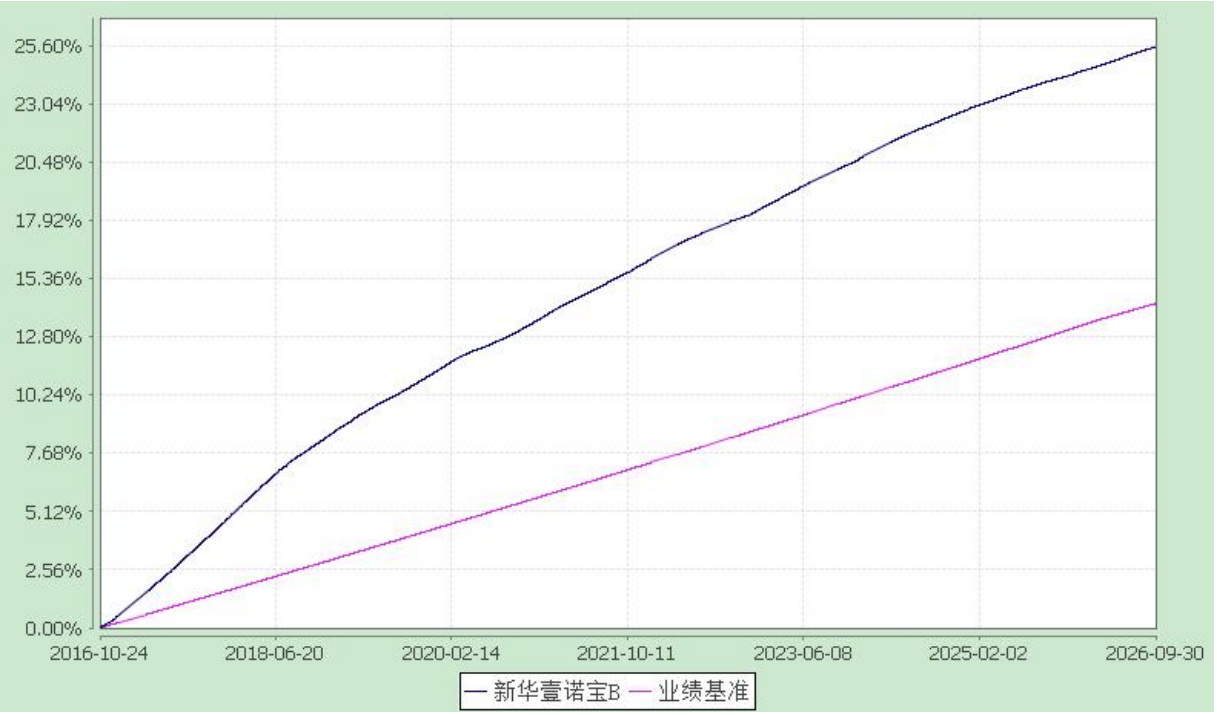
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 12 月 3 日至 2026 年 9 月 30 日)

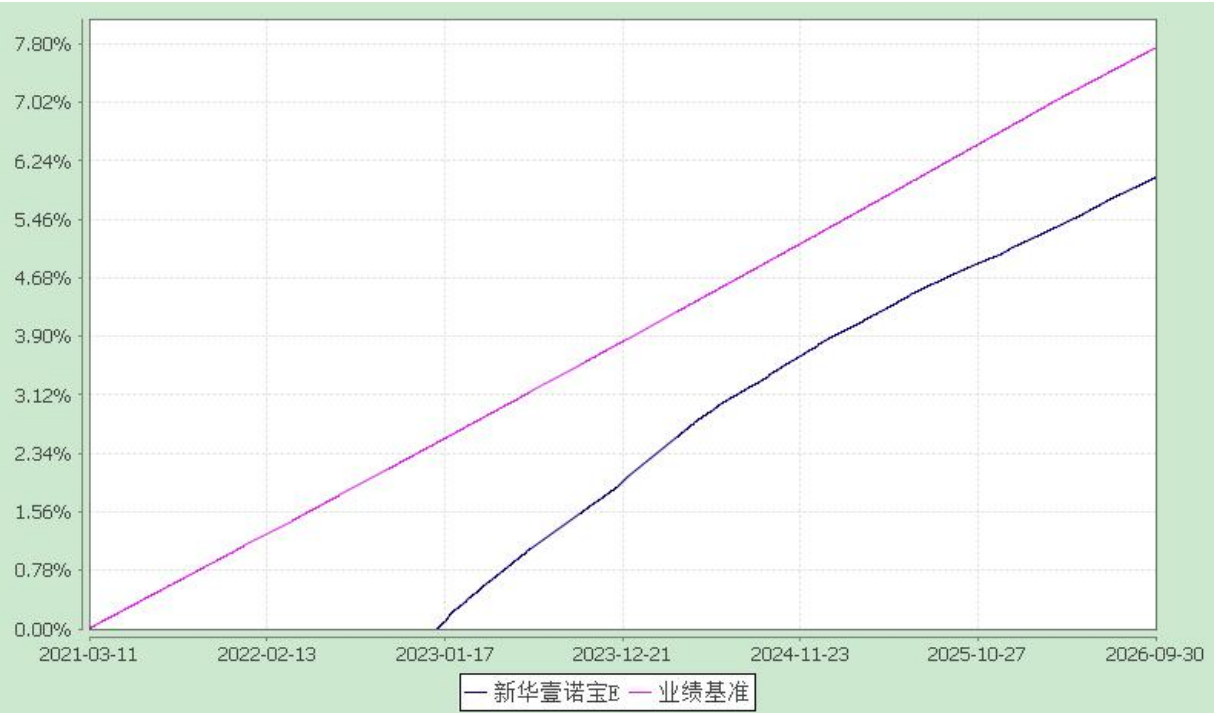
1、新华壹诺宝 A



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	2020-07-13	-	14	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。

	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、新华中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。				
于航	本基金基金经理，新华丰利债券型证券投资基金基金经理、新华活期添利货币市场基金基金经理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理。	2026-02-11	-	11	统计学硕士，曾任新华基金固定收益投资部研究员、基金经理助理、基金经理。

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遵规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华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 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，宏观经济总体平稳、边际走弱。国内出口保持韧性，但内需不足、复苏斜率放缓；工业增加值温和回落，PMI 在荣枯线附近反复。国际大宗及原油价格维持高位，输入性通胀压力仍有待消化。货币政策方面，央行坚持适度宽松、精准调控，未降准降息；7 天逆回购利率稳于 1.40%，LPR 连续 16 个月持稳。季末打出结构性“组合拳”——PSL 利率降至 1.50%、再贷款额度加码。银行间资金面整体均衡，DR007 围绕政策利率在 1.37%－1.45% 区间窄幅波动，季末扰动可控。债市收益率低位震荡下行：1 年期 AAA 同业存单收益率围绕 1.45%－1.52%波动、季末收于 1.48%；1 年期国债收益率在 1.18%－1.25%运行、季末 1.21%;10 年期国债收益率由季初约 1.72%下行至季末 1.68%附近，季中最低 1.66%。

报告期内，本基金规模略有波动，继续秉持稳健投资原则谨慎运作，以流动性管理为核心，灵活调整同业存单、利率债及银行存款等资产配置比例，在充分保障组合安全性与流动性的前提下，努力为基金份额持有人获取稳健的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内 A 类（000434）基金份额净值收益率为 0.2454%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%，B 类（003267）基金份额净值收益率为 0.3060%，同期业绩比较

基准收益率为 0.3403%，E 类（009099）基金份额净值收益率为 0.2963%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

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	1,675,037,124.11	75.56
	其中：债券	1,675,037,124.11	75.56
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	541,884,191.00	24.44
4	其他资产	-	-
5	合计	2,216,921,315.11	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	0.24	
	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	52,001,852.52	2.40
	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	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

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	14.82	2.40
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	13.40	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

3	60天（含）—90天	21.21	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	8.30	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	44.59	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		102.31	2.40

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	-	-
5	企业短期融资券	391,717,439.23	18.10
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,283,319,684.88	59.30
8	其他	-	-
9	合计	1,675,037,124.11	77.41

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	112517262	25 光大银行 CD262	1,000,000.00	99,721,156.71	4.61
2	112603105	26 农业银行 CD105	1,000,000.00	99,439,808.75	4.60
3	112621218	26 渤海银行 CD218	1,000,000.00	99,353,123.36	4.59
4	112612042	26 北京银行 CD042	1,000,000.00	99,296,692.49	4.59
5	112609088	26 浦发银行 CD088	1,000,000.00	99,295,320.60	4.59
6	012681000	26 中交建筑 SCP002	500,000.00	50,264,558.14	2.32
7	012681211	26 厦国贸 SCP013	500,000.00	50,250,462.82	2.32
8	012681312	26 南航股 SCP011	500,000.00	50,182,297.12	2.32
9	012681694	26 中核租赁 SCP003	500,000.00	50,126,406.11	2.32
10	112585397	25 汉口银行 CD177	500,000.00	49,899,248.81	2.31

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 次
报告期内偏离度的最高值	0.0233%
报告期内偏离度的最低值	0.0049%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0114%

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。

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，中国光大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的处罚；渤海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天津市分局、国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚；北京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、国家金融监督管理总局北京监管局的处罚；上海浦东发展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上海市分局、国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚；中交建筑集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到乡宁县城市管理综合行政执法队、江苏省交通运输综合行政执法监督局的处罚；中国南方航空股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国民用航空中南地区管理局的处罚。

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

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	1,372,667,235.93	547,049,467.80	18,341.09
报告期期间基金总申购份额	9,107,782,695.16	11,142,592,982.89	173,789,064.89
报告期期间基金总赎回份额	8,787,588,863.85	11,315,678,503.39	76,688,498.09
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	1,692,861,067.24	373,963,947.30	97,118,907.89

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 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

二〇二六年十月二十七日