诺安天天宝货币市场基金

2023 年中期报告

2023 年 06 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

送出日期：2023 年 08 月 31 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 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遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 17
6.3 净资产（基金净值）变动表 18
6.4 报表附注 20
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 债券回购融资情况 39
7.3 基金投资组合平均剩余期限 39
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 40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
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 40
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 41
7.8 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 41
7.9 投资组合报告附注 41
§8 基金份额持有人信息 43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 43
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情况 44
§9 开放式基金份额变动 44
§10 重大事件揭示 45
10.1 基金份额持有人大会决议 45
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 45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 45
10.4 基金投资策略的改变 45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 46
10.9 其他重大事件 46
§11 影响投资者决策的其他重要信息 48
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 48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 48
§12 备查文件目录 48
12.1 备查文件目录 48
12.2 存放地点 49
12.3 查阅方式 49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安天天宝货币市场基金			
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			
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			
报告期末基金份额总额	99,961,026,931.95 份			
基金合同存续期	不定期			
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	97,842,245,009.32 份	22,081,696.24 份	907,483.27 份	2,095,792,743.12 份

2.2 基金产品说明

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。

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		诺安基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	秦一楠
	联系电话	0755-83026688	010-66060069
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95599
传真		0755-83026677	010-68121816
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行	北京市西城区复兴门内大街 28

	大厦 19-20 层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	李强	谷澍

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.lionfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 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（2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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
本期已实现收益	883,477,937.49	242,961.76	7,346.15	73,523,887.87
本期利润	883,477,937.49	242,961.76	7,346.15	73,523,887.87
本期净值收益率	1.0032%	1.0779%	1.0285%	1.0773%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 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
期末基金资产净值	97,842,245,009.32	22,081,696.24	907,483.27	2,095,792,743.12
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 06 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
累计净值收益率	28.3753%	31.1302%	26.3714%	30.2922%

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。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。

2、自 2014 年 04 月 28 日起，增加诺安天天宝 B 类基金份额类别；自 2014 年 09 月 24 日起，增加诺

安天天宝 C 类份额。增加基金份额类别后，本基金将分设 A 类、E 类、B 类及 C 类四类基金份额，详情请参阅相关公告。

3、本基金的收益分配是按日结转份额。

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	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	0.1600%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1308%	0.0002%
过去三个月	0.4932%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.4047%	0.0002%
过去六个月	1.0032%	0.0003%	0.1760%	0.0000%	0.8272%	0.0003%
过去一年	1.8694%	0.0007%	0.3549%	0.0000%	1.5145%	0.0007%
过去三年	6.1240%	0.0007%	1.0646%	0.0000%	5.0594%	0.0007%
自基金合同生效起至今	28.3753%	0.0047%	3.2910%	0.0000%	25.0843%	0.0047%

诺安天天宝货币 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	0.1724%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1432%	0.0002%
过去三个月	0.5307%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.4422%	0.0002%
过去六个月	1.0779%	0.0003%	0.1760%	0.0000%	0.9019%	0.0003%
过去一年	2.0210%	0.0007%	0.3549%	0.0000%	1.6661%	0.0007%
过去三年	6.5982%	0.0007%	1.0646%	0.0000%	5.5336%	0.0007%
自基金合同生效起至今	31.1302%	0.0048%	3.2579%	0.0000%	27.8723%	0.0048%

诺安天天宝货币 C

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	0.1639%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1347%	0.0002%
过去三个月	0.5054%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.4169%	0.0002%
过去六个月	1.0285%	0.0004%	0.1760%	0.0000%	0.8525%	0.0004%
过去一年	1.9226%	0.0007%	0.3549%	0.0000%	1.5677%	0.0007%
过去三年	6.2853%	0.0007%	1.0646%	0.0000%	5.2207%	0.0007%
自基金合同生效起至今	26.3714%	0.0046%	3.1131%	0.0000%	23.2583%	0.0046%

诺安天天宝货币 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	0.1707%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1415%	0.0002%
过去三个月	0.5292%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.4407%	0.0002%
过去六个月	1.0773%	0.0004%	0.1760%	0.0000%	0.9013%	0.0004%

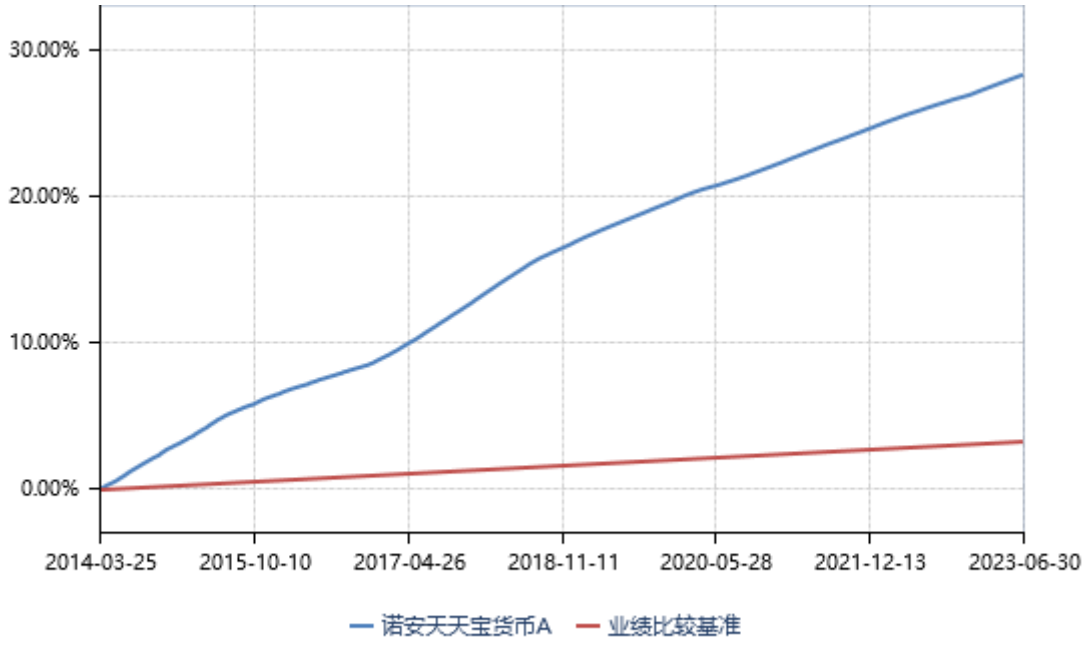
过去一年	2.0204%	0.0007%	0.3549%	0.0000%	1.6655%	0.0007%
过去三年	6.5980%	0.0007%	1.0646%	0.0000%	5.5334%	0.0007%
自基金合同生效起至今	30.2922%	0.0047%	3.2910%	0.0000%	27.0012%	0.0047%

注：1、本基金的利润分配方式是“每日分配，按日支付”。

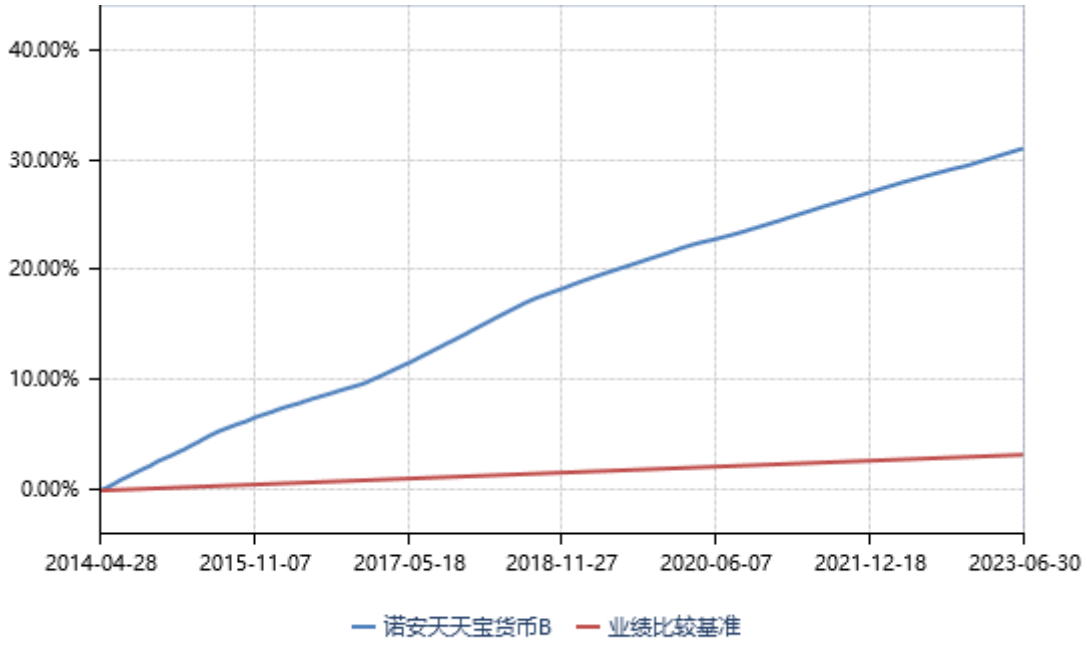
2、本基金的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。

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

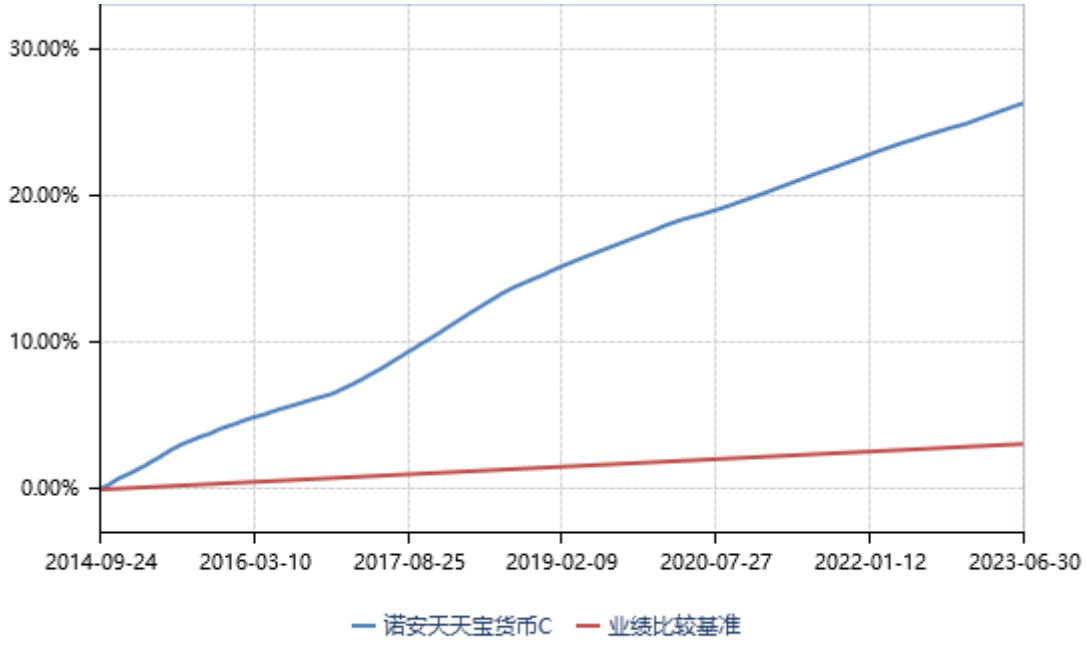
诺安天天宝货币 A



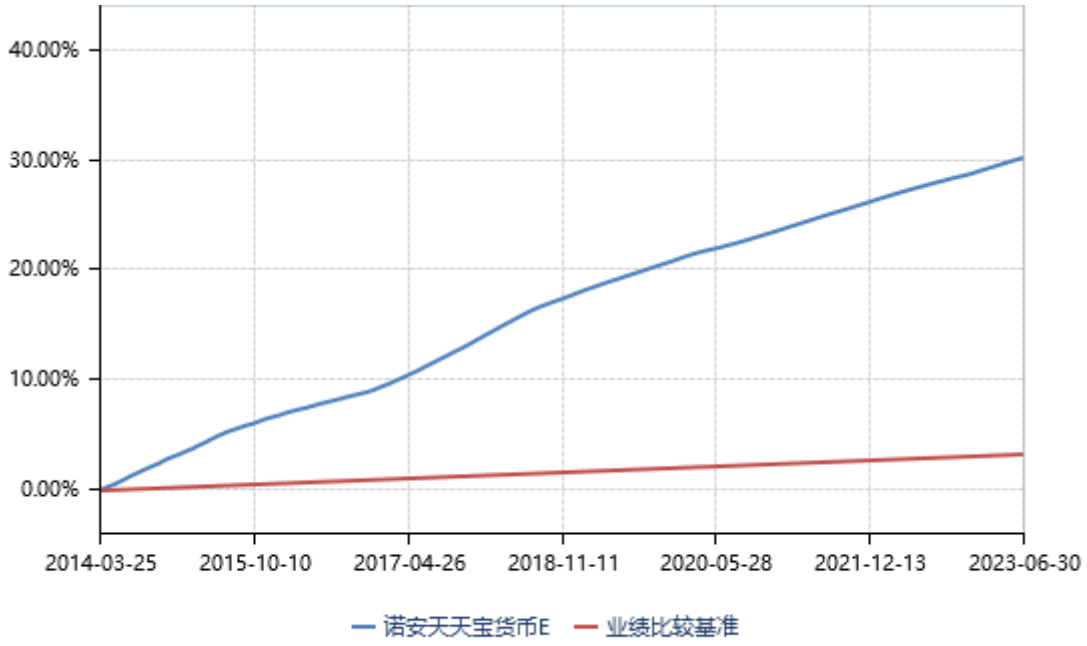
诺安天天宝货币 B



诺安天天宝货币 C



诺安天天宝货币 E



§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

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增

强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金、诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
岳帅	本基金基金经理	2019 年 10 月 15 日	-	13 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，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。
潘飞	本基金基金经理	2021 年 11 月 13 日	-	13 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，任基金经理助理，从事资金、债券交易工作，现任固定收益事业部总经理助理。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此处基金经理的任职日期均为公司作出决定并对外公告之日；

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 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

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，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等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，并将申购指令下达给交易中心。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 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

2023 年 1 季度在疫情政策放开后，需求集中释放，经济基本面预期和实际运行数据均快速修正。债市则表现较强，主要原因是对 2022 年底出现的急速踩踏式行情的修复，尤其两会经济增速目标调整至 5%后，“不大干快上”的要求使得市场对未来增长上限的强预期有所修正，市场普遍预期不会有强刺激政策出台，货币政策在经济内生动力自然修复状态下不会发生逆转，叠加央行超预期降准、海外银行风波和理财等机构相对欠配等作用下，债市表现偏强势。2 季度正式进入后疫情时代，在经济内生动能和居民信心修复较弱背景下，货币政策保持相对宽松状态，进入 6 月份央行超预期降低政策利率，债市收益率受此影响大幅下行，降息落地后市场对稳增长政策预期再次升温，叠加 6 月关键月份资金利率持续攀升，债市收益率小幅回调，二季度看债市收益率仍以下行为主。

操作上，本基金在做好流动性管理的基础上，上半年重点通过增加较长期限的存款、存单和短融等资产的配置，灵活调整组合持仓结构，增厚了组合收益。管理人始终坚持“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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

1、截至报告期末，本基金投资组合的剩余期限为 119 天，影子定价偏离度为 0.0368%。

2、本报告期内，诺安天天宝货币 A 份额净值收益率为 1.0032%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%；诺安天天宝货币 B 份额净值收益率为 1.0779%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%；诺安天天宝货币 C 份额净值收益率为 1.0285%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%；诺安天天宝货币 E 份额净值收益率为 1.0773%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，央行先于美联储议息会议和国内经济数据落地宣布降息，稳增长和稳信心意图明显，后续大概率会有一揽子扩需求的政策出台，加上国内已有部分经济数据环比改善，债市正式进入降息观察期和政策落地真空期，债市短期内仍将演绎稳增长预期升温的逻辑，市场博弈焦点在于潜在的稳增长政策力度和经济实际表现的预期差。综合分析国内外经济形势和政策定力，大开大合政策出台的概率依旧偏低，国内货币政策在经济动能依旧偏弱和政策效果显现之前大概率会维持稳定偏宽松状态。在此背景下，债市策略维持中性，套息策略仍有效，但须警惕潜在政策超预期因素的发酵对债市情绪的影响，需重点关注组合持仓券的流动性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照企业会计准则、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的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责研究、指导基金估值业务，制定和适时修订基金的估值政策和程序。估值委员会由督察长、投资、研究、风险管理、法律合规和基金运营等部门负责人及指定人员组成，估值委员会成员具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

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《基金合同》约定，本基金收益每日分配，按日支付，本基金本期实现收益为 957,252,133.27 元，应分配利润 957,252,133.27 元，已实施分配利润 957,252,133.27 元，符合合同约定。

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

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 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—诺安基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，诺安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运

作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，诺安基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：诺安天天宝货币市场基金
报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	60,858,300,317.69	58,274,114,809.83
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	31,195,909,124.68	21,540,068,958.92
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		31,195,909,124.68	21,540,068,958.92
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	15,644,607,426.07	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		448,477.39	4,218,779.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		107,699,265,345.83	79,818,402,548.46
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 06 月 30 日**	**上年度末 2022 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		7,678,016,904.61	1,139,568,960.71
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		25,449,365.53	19,867,197.31
应付托管费		8,483,121.88	6,622,399.13
应付销售服务费		20,431,060.79	16,015,099.42
应付投资顾问费		-	-
应交税费		39,392.85	159,951.26
应付利润		5,361,990.63	9,442,943.96
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	456,577.59	551,801.23
负债合计		7,738,238,413.88	1,192,228,353.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	99,961,026,931.95	78,626,174,195.44
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		99,961,026,931.95	78,626,174,195.44
负债和净资产总计		107,699,265,345.83	79,818,402,548.46

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，诺安天天宝货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 97,842,245,009.32 份；诺安天天宝货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 22,081,696.24 份；诺安天天宝货币 C 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 907,483.27 份；诺安天天宝货币 E 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,095,792,743.12 份。诺安天天宝货币份额总额合计为 99,961,026,931.95 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安天天宝货币市场基金
本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		1,320,277,204.99	828,787,255.52
1.利息收入		1,043,989,087.60	637,235,573.16
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,025,137,209.18	558,663,983.54
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		18,851,878.42	78,571,589.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		276,288,117.39	191,551,682.36

其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	276,288,117.39	191,551,682.36
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	-	-
股利收益	6.4.7.12	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-	-
减：二、营业总支出		363,025,071.72	218,285,186.33
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	141,918,710.81	94,111,226.41
2．托管费	6.4.10.2.2	47,306,237.01	31,370,408.86
3．销售服务费	6.4.10.2.3	113,148,040.55	76,235,870.90
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		60,364,025.42	16,310,168.51
其中：卖出回购金融资产支出		60,364,025.42	16,310,168.51
6．信用减值损失	6.4.7.15	-	-
7．税金及附加		82,342.01	54,273.90
8．其他费用	6.4.7.16	205,715.92	203,237.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		957,252,133.27	610,502,069.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		957,252,133.27	610,502,069.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		957,252,133.27	610,502,069.19

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安天天宝货币市场基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	78,626,174,195.44	-	-	78,626,174,195.44
二、本期期初净资产（基金净值）	78,626,174,195.44	-	-	78,626,174,195.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	21,334,852,736.51	-	-	21,334,852,736.51
（一）、综合收益总额	-	-	957,252,133.27	957,252,133.27

（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	21,334,852,736.51	-	-	21,334,852,736.51
其中：1.基金申购款	412,008,746,756.32	-	-	412,008,746,756.32
2.基金赎回款	-390,673,894,019.81	-	-	-390,673,894,019.81
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-957,252,133.27	-957,252,133.27
四、本期期末净资产（基金净值）	99,961,026,931.95	-	-	99,961,026,931.95
项目	**上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日**			
	实收基金	**其他综合收益**	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产（基金净值）	58,903,166,492.33	-	-	58,903,166,492.33
二、本期期初净资产（基金净值）	58,903,166,492.33	-	-	58,903,166,492.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,024,343,165.37	-	-	4,024,343,165.37
（一）、综合收益总额	-	-	610,502,069.19	610,502,069.19
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,024,343,165.37	-	-	4,024,343,165.37
其中：1.基金申购款	354,833,503,896.49	-	-	354,833,503,896.49
2.基金赎回款	-350,809,160,731.12	-	-	-350,809,160,731.12
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-610,502,069.19	-610,502,069.19
四、本期期末净资产（基金净值）	62,927,509,657.70	-	-	62,927,509,657.70

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：

齐斌	田冲	何柳姿
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安天天宝货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准诺安天天宝货币市场基金募集的批复》（证监许可〔2014〕184 号）批准，由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安天天宝货币市场基金基金合同》发售，基金合同于 2014 年 3 月 25 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 3,639,696,827.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 370,352.18 份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金设 A 类和 E 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，在基金合同生效后合并投资运作，按照不同的费率标准计提销售服务费，单独公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。E 类基金份额通过基金管理人指定的交易平台办理认（申）购、赎回等业务。根据 2014 年 4 月 28 日公告的《诺安基金管理有限公司关于诺安天天宝货币市场基金新增基金份额类别的公告》，自 2014 年 4 月 28 日起，本基金增加诺安天天宝 B 类基金份额，分级后本基金分设 A 类、E 类及 B 类三类基金份额；根据 2014 年 9 月 24 日公告的《诺安基金管理有限公司关于诺安天天宝货币市场基金新增基金份额类别的公告》，自 2014 年 9 月 24 日起，本基金增加诺安天天宝 C 类基金份额，分级后本基金设四类基金份额：A 类、E 类、B 类、C 类。本基金四类基金份额分别设置基金代码，A 级基金份额基金代码为 000559，基金简称为“诺安天天宝货币 A”；E 级基金份额基金代码为 000560，基金简称为“诺安天天宝货币 E”；B 级基金份额基金代码为 000625，基金简称为“诺安天天宝货币 B”；C 级基金份额基金代码为 000818，基金简称为“诺安天天宝货币 C”。不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安天天宝货币市场基金基金合同》和《诺安天天宝货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：1、现金；2、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；3、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的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（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金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。

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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

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〔2008〕132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、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《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定等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；存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、质押式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。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，包括买卖债券的差价收入，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，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	23,162,227,067.45
等于：本金	23,140,406,278.80
加：应计利息	21,820,788.65
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	37,696,073,250.24
等于：本金	37,400,000,000.00
加：应计利息	296,073,250.24
合计	60,858,300,317.69

注：“其他存款”列示的是协议存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 06 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	31,195,909,124.68	31,232,652,132.72	36,743,008.04	0.0368
	合计	31,195,909,124.68	31,232,652,132.72	36,743,008.04	0.0368
资产支持证券		-	-	-	-
合计		31,195,909,124.68	31,232,652,132.72	36,743,008.04	0.0368

注：本报告期末，本基金交易性金融资产均为采用实际利率法计算的债券账面价值。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与按实际利率计算的账面价值间的差异在合理范围内。

1.偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；

2.偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值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 2023 年 06 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	15,644,607,426.07	-
合计	15,644,607,426.07	-

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

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 2023 年 06 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	342,098.64
其中：交易所市场	-
银行间市场	342,098.64
应付利息	-
预提费用	114,478.95
合计	456,577.59

6.4.7.7 实收基金

诺安天天宝货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	76,261,838,508.43	76,261,838,508.43
本期申购	401,761,492,002.37	401,761,492,002.37
本期赎回（以“-”号填列）	-380,181,085,501.48	-380,181,085,501.48
本期末	97,842,245,009.32	97,842,245,009.32

诺安天天宝货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,548,817.79	24,548,817.79
本期申购	3,764,060.60	3,764,060.60
本期赎回（以“-”号填列）	-6,231,182.15	-6,231,182.15
本期末	22,081,696.24	22,081,696.24

诺安天天宝货币 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	456,681.96	456,681.96
本期申购	1,773,445.28	1,773,445.28
本期赎回（以“-”号填列）	-1,322,643.97	-1,322,643.97
本期末	907,483.27	907,483.27

诺安天天宝货币 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,339,330,187.26	2,339,330,187.26
本期申购	10,241,717,248.07	10,241,717,248.07
本期赎回（以“-”号填列）	-10,485,254,692.21	-10,485,254,692.21
本期末	2,095,792,743.12	2,095,792,743.12

6.4.7.8 未分配利润

诺安天天宝货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	883,477,937.49	-	883,477,937.49
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	-883,477,937.49	-	-883,477,937.49
本期末	-	-	-

诺安天天宝货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	242,961.76	-	242,961.76
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	-242,961.76	-	-242,961.76
本期末	-	-	-

诺安天天宝货币 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

本期期初	-	-	-
本期利润	7,346.15	-	7,346.15
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	-7,346.15	-	-7,346.15
本期末	-	-	-

诺安天天宝货币 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	73,523,887.87	-	73,523,887.87
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	-73,523,887.87	-	-73,523,887.87
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	544,015,694.96
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	480,446,809.57
结算备付金利息收入	-
其他	674,704.65
合计	1,025,137,209.18

注：此处“其他”列示的是申购款利息收入，“其他存款利息收入”列示的是协议存款利息收入。

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益--利息收入	262,110,113.17
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	14,178,004.22
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	276,288,117.39

6.4.7.10.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	23,200,994,114.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,124,973,466.98
减：应计利息总额	61,842,643.45
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	14,178,004.22

6.4.7.11 衍生工具收益

6.4.7.11.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.12 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.13 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.14 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.15 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	87,936.97
账户维护费	18,600.00
合计	205,715.92

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明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

本基金本报告期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
诺安基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
诺安资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	141,918,710.81	94,111,226.41
其中：支付销售机构的客户维护费	65,934,743.14	45,423,943.62

注：本基金的管理费率为年费率 0.30%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.30%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	47,306,237.01	31,370,408.86

注：本基金的托管费率为年费率 0.10%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	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	合计
诺安基金管理有限公司	238.68	10,429.51	16.12	3,330,525.35	3,341,209.66
中国农业银行股份有限公司	18,763.86	-	-	-	18,763.86
合计	19,002.54	10,429.51	16.12	3,330,525.35	3,359,973.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	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	合计
诺安基金管理有限公司	10,116.78	10,791.04	9.48	854,864.35	875,781.65
中国农业银行股份有限公司	14,928.04	-	-	-	14,928.04
合计	25,044.82	10,791.04	9.48	854,864.35	890,709.69

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，诺安天天宝货币 A 销售服务费年费率为 0.25%，诺安天天宝货币 B 销售服务费年费率为 0.10%，诺安天天宝货币 C 销售服务费年费率为 0.20%，诺安天天宝

货币 E 销售服务费年费率为 0.10%。

各类基金份额的销售服务费的计算公式如下：

H＝E×R÷当年天数

H 为该类基金份额每日计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

R 为该类基金份额的销售服务费率

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

诺安天天宝货币 E

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
诺安资产管理有限公司	-	-	133,238,775.71	0.17%

注：关联方投资本基金相关费率按照基金合同及招募说明书的规定执行。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司-活期存款	23,162,227,067.45	544,015,694.96	19,031,143,091.99	196,234,854.22

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

诺安天天宝货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
887,373,855.80	4,447.73	-3,900,366.04	883,477,937.49	-

诺安天天宝货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
244,810.53	20.57	-1,869.34	242,961.76	-

诺安天天宝货币 C

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
7,346.69	5.65	-6.19	7,346.15	-

诺安天天宝货币 E

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
73,312,098.37	390,501.26	-178,711.76	73,523,887.87	-

6.4.12 期末 2023 年 06 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 7,678,016,904.61 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012381211	23 鲁招金 SCP001(科创票据)	2023 年 07 月 03 日	100.45	564,000	56,652,064.33
012381373	23 厦国贸控 SCP004	2023 年 07 月 03 日	100.43	500,000	50,214,395.92
012382055	23 鲁金 SCP002(科创票据)	2023 年 07 月 03 日	99.99	500,000	49,993,119.94
012382237	23 汉江国资 SCP001	2023 年 07 月 03 日	100.09	394,000	39,435,262.97
092218001	22 农发清发 01	2023 年 07 月 07 日	100.71	6,900,000	694,883,327.29
112285294	22 昆仑银行 CD031	2023 年 07 月 03 日	99.66	1,760,000	175,406,391.30
112303127	23 农业银行 CD127	2023 年 07 月 03 日	99.50	9,217,000	917,069,465.18
112312040	23 北京银行 CD040	2023 年 07 月 03 日	98.10	13,108,000	1,285,899,213.70
112321115	23 渤海银行 CD115	2023 年 07 月 03 日	98.72	10,000,000	987,199,084.65
112321128	23 渤海银行 CD128	2023 年 07 月 03 日	98.00	2,000,000	195,993,915.91
112321161	23 渤海银行 CD161	2023 年 07 月 03 日	97.82	4,500,000	440,170,470.36
112321199	23 渤海银行 CD199	2023 年 07 月 03 日	98.39	3,736,000	367,601,884.29
112395170	23 厦门国际银行 CD035	2023 年 07 月 03 日	98.05	4,200,000	411,806,735.42
112396902	23 广州农村商业银行 CD047	2023 年 07 月 03 日	97.89	3,000,000	293,666,547.51
112398695	23 贵州银行 CD037	2023 年 07 月 03 日	97.74	18,666,000	1,824,351,434.23
190305	19 进出 05	2023 年 07 月 03 日	101.73	3,000,000	305,193,914.99
220216	22 国开 16	2023 年 07 月 03 日	100.89	2,000,000	201,775,873.11
220411	22 农发 11	2023 年 07 月	101.10	200,000	20,220,343.32

		03 日			
合计				84,245,000	8,317,533,444.42

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证券款余额。

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

本基金为货币市场基金，属于高流动性、低风险的基金品种，其预期风险和预期收益均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金投资于货币市场工具，包括：现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的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。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在存放协议存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基

金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券市值的 10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	764,478,440.18	4,801,451,173.60
合计	764,478,440.18	4,801,451,173.60

注：未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,431,353,442.22	16,279,030,108.16
合计	29,431,353,442.22	16,279,030,108.16

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,000,077,242.28	459,587,677.16
合计	1,000,077,242.28	459,587,677.16

注：未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值、份额持有人集中度以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此，除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，均能够及时变现。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般约为未折现的合约到期现金流量。

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。利率敏感性

金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债都计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受到市场利率变化的影响。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。本基金持有的生息资产主要为银行存款、债券投资及买入返售金融资产等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	41,760,783,291.58	19,097,517,026.11	-	-	-	60,858,300,317.69
交易性金融资产	17,085,977,156.76	14,109,931,967.92	-	-	-	31,195,909,124.68
买入返售金融资产	15,644,607,426.07	-	-	-	-	15,644,607,426.07
应收申购款	-	-	-	-	448,477.39	448,477.39
资产总计	74,491,367,874.41	33,207,448,994.03	-	-	448,477.39	107,699,265,345.83
负债						
卖出回购金融资产款	7,678,016,904.61	-	-	-	-	7,678,016,904.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	25,449,365.53	25,449,365.53
应付托管费	-	-	-	-	8,483,121.88	8,483,121.88
应付销售服务费	-	-	-	-	20,431,060.79	20,431,060.79
应交税费	-	-	-	-	39,392.85	39,392.85
应付利润	-	-	-	-	5,361,990.63	5,361,990.63
其他负债	-	-	-	-	456,577.59	456,577.59
负债总计	7,678,016,904.61	-	-	-	60,221,509.27	7,738,238,413.88
利率敏感度缺口	66,813,350,969.80	33,207,448,994.03	-	-	-59,773,031.88	99,961,026,931.95

上年度末 2022 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	51,456,194,115.83	6,817,920,694.00	-	-	-	58,274,114,809.83
交易性金融资产	12,597,130,851.54	8,942,938,107.38	-	-	-	21,540,068,958.92
应收申购款	42,295.00	-	-	-	4,176,484.71	4,218,779.71
资产总计	64,053,367,262.37	15,760,858,801.38	-	-	4,176,484.71	79,818,402,548.46
负债						
卖出回购金融资产款	1,139,568,960.71	-	-	-	-	1,139,568,960.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	19,867,197.31	19,867,197.31
应付托管费	-	-	-	-	6,622,399.13	6,622,399.13
应付销售服务费	-	-	-	-	16,015,099.42	16,015,099.42
应交税费	-	-	-	-	159,951.26	159,951.26
应付利润	-	-	-	-	9,442,943.96	9,442,943.96
其他负债	-	-	-	-	551,801.23	551,801.23
负债总计	1,139,568,960.71	-	-	-	52,659,392.31	1,192,228,353.02
利率敏感度缺口	62,913,798,301.66	15,760,858,801.38	-	-	-48,482,907.60	78,626,174,195.44

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元 ）	
		本期末（2023 年 06 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 27 个基点	38,705,143.83	25,798,892.47
	市场利率上升 27 个基点	-38,705,143.83	-25,798,892.47

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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

其他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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	31,195,909,124.68	21,540,068,958.92
第三层次	-	-
合计	31,195,909,124.68	21,540,068,958.92

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，其剩余期限较短，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

本基金无需说明的其他重要事项。

§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（%）
1	固定收益投资	31,195,909,124.68	28.97
	其中：债券	31,195,909,124.68	28.97
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	15,644,607,426.07	14.53
	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	60,858,300,317.69	56.51
4	其他各项资产	448,477.39	0.00
5	合计	107,699,265,345.83	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	6.47	
	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	7,678,016,904.61	7.68
	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%。

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	119
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	73

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。

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	42.49	7.68

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	6.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	11.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	45.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		107.40	7.68

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,222,073,458.71	1.22
	其中：政策性金融债	1,222,073,458.71	1.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	542,482,223.75	0.54
6	中期票据	-	-
7	同业存单	29,431,353,442.22	29.44
8	其他	-	-
9	合计	31,195,909,124.68	31.21
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）	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	112303127	23 农业银行 CD127	32,000,000	3,183,923,498.52	3.19

2	112398695	23 贵州银行 CD037	19,000,000	1,856,995,459.68	1.86
3	112312040	23 北京银行 CD040	15,000,000	1,471,505,050.77	1.47
4	112381752	23 杭州银行 CD162	14,000,000	1,392,635,220.69	1.39
5	112381453	23 北京农商银行 CD152	10,000,000	995,118,653.70	1.00
6	112381693	23 湖南银行 CD099	10,000,000	994,619,862.75	1.00
7	112321115	23 渤海银行 CD115	10,000,000	987,199,084.65	0.99
8	112380212	23 贵州银行 CD051	8,000,000	781,098,036.58	0.78
9	092218001	22 农发清发 01	6,900,000	694,883,327.29	0.70
10	112395031	23 青岛农商行 CD080	5,500,000	539,193,688.46	0.54

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	0.0468%
报告期内偏离度的最低值	-0.0234%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0186%

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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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，除北京银行、青岛农村商业银行、农业银行外，本报告期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。

（1）北京银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局北京外汇管理部、中国银行保险监督管理委员会北京监管局的行政处罚。

截至本报告期末，23 北京银行 CD040（112312040）为本基金前十大重仓证券。北京银行作为大型上市股份制商业银行，综合竞争力强，经营业绩保持增长，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力，因此本基金才继续持有。本基金对该证券的投资符合法律法规和公司制度。

（2）青岛农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会青岛监管局的行政处罚。

截至本报告期末，23 青岛农商行 CD080（112395031）为本基金前十大重仓证券。青岛农商行具备良好的区域优势和竞争力，整体经营良好，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力，因此本基金才继续持有。本基金对该证券的投资符合法律法规和公司制度。

（3）中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚。

截至本报告期末，23 农业银行 CD127（112303127）为本基金前十大重仓证券。农业银行作为大型全国性上市国有股份制商业银行，综合竞争力强，经营业绩保持增长，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力，因此本基金才继续持有。本基金对该证券的投资符合法律法规和公司制度。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	448,477.39
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	448,477.39

7.9.4 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。

§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
诺安天天宝货币 A	10,185,688	9,605.86	1,062,547,195.57	1.09%	96,779,697,813.75	98.91%
诺安天天宝货币 B	95,103	232.19	23,957.91	0.11%	22,057,738.33	99.89%
诺安天天宝货币 C	284	3,195.36	1,248.66	0.14%	906,234.61	99.86%
诺安天天宝货币 E	61,367	34,151.79	1,921,411,336.76	91.68%	174,381,406.36	8.32%
合计	10,342,442	9,665.13	2,983,983,738.90	2.99%	96,977,043,193.05	97.01%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	银行类机构	1,010,539,301.14	1.01%
2	银行类机构	500,118,397.54	0.50%
3	银行类机构	201,059,607.95	0.20%
4	银行类机构	106,295,576.08	0.11%
5	银行类机构	100,005,842.55	0.10%
6	个人	31,474,568.84	0.03%
7	个人	28,236,851.87	0.03%
8	个人	18,420,992.32	0.02%
9	个人	15,629,976.31	0.02%
10	个人	14,924,455.63	0.01%

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员持有本基金	诺安天天宝货币 A	141,097.39	0.0001%
	诺安天天宝货币 B	41,290.13	0.1870%
	诺安天天宝货币 C	5.09	0.0006%
	诺安天天宝货币 E	2,269,684.65	0.1083%
	合计	2,452,077.26	0.0025%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	诺安天天宝货币 A	0~10
	诺安天天宝货币 B	0
	诺安天天宝货币 C	0
	诺安天天宝货币 E	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安天天宝货币 A	0
	诺安天天宝货币 B	0
	诺安天天宝货币 C	0
	诺安天天宝货币 E	10~50
	合计	10~50

§9 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
基金合同生效日（2014 年 03 月 25 日）基金份额总额	3,639,448,943.43	-	-	618,236.11
本报告期期初基金份额总额	76,261,838,508.43	24,548,817.79	456,681.96	2,339,330,187.26
本报告期基金总申购份额	401,761,492,002.37	3,764,060.60	1,773,445.28	10,241,717,248.07
减：本报告期基金总赎回份额	380,181,085,501.48	6,231,182.15	1,322,643.97	10,485,254,692.21
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-

本报告期期末基金份额总额	97,842,245,009.32	22,081,696.24	907,483.27	2,095,792,743.12

§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，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

俞任君先生担任公司监事，赵星明先生、梅律吾先生不再担任公司监事。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人基金管理业务、本基金基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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未受到稽查或处罚。

10.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	

渤海证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

（1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

（3）经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。

（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

（5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

（6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

10.8 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。

10.9 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	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年01月05日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行招赢通平台为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》	2023年01月06日
3	诺安天天宝货币市场基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023年01月20日
4	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年01月20日
5	诺安天天宝货币市场基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《证券时报》	2023年02月17日
6	诺安天天宝货币市场基金基金产品资料	基金管理人网站	2023年02月17日

	概要更新		
7	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》	2023年02月17日
8	诺安天天宝货币市场基金招募说明书（更新）2023 年第 1 期	基金管理人网站	2023年02月17日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加济安财富为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月03日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2023年03月14日
11	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月15日
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2023年03月28日
13	诺安基金管理有限公司关于诺安天天宝货币市场基金暂停在直销渠道办理申购（含定投）、转换转入业务的公告	《证券时报》	2023年03月28日
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加南京证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月29日
15	诺安天天宝货币市场基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023年03月31日
16	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月31日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年04月20日
18	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加安信证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2023年04月21日
19	诺安天天宝货币市场基金 2023 年第 1 季	基金管理人网站	2023年04月22日

	度报告		
20	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年04月22日
21	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加博时财富为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年05月15日
22	诺安基金管理有限公司关于终止晋商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》	2023年05月20日
23	诺安基金管理有限公司关于旗下部分货币基金在雪球基金开通快速赎回业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》	2023年06月27日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站进行披露。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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%的情形，敬请投资者留意。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无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

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公开募集的文件。

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基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤报告期内诺安天天宝货币市场基金在指定媒介上披露的各项公告。

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
2023 年 08 月 31 日