

**泓德泓利货币市场基金2016年年度报告**

**2016年12月31日**

**基金管理人：泓德基金管理有限公司**

**基金托管人：交通银行股份有限公司**

**送出日期：2017年3月28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。本年度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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2016年1月1日起至12月31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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	10
§4	管理人报告	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6	审计报告	16
6.1	审计报告基本信息	16
6.2	审计报告的基本内容	17
§7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4	报表附注	23
§8	投资组合报告	44
8.1	期末基金资产组合情况	44
8.2	债券回购融资情况	45
8.3	基金投资组合平均剩余期限	45
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	46
8.6	期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细	47
8.7	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	48
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	48
8.9	投资组合报告附注	48
§9	基金份额持有人信息	49
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	50
9.3	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	50
§10	开放式基金份额变动	50
§11	重大事件揭示	51

11.1	基金份额持有人大会决议.....	51
11.2	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.....	51
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
11.4	基金投资策略的改变.....	51
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	53
11.9	其他重大事件.....	53
§12	备查文件目录.....	56
12.1	备查文件目录.....	56
12.2	存放地点.....	56
12.3	查阅方式.....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泓德泓利货币市场基金	
基金简称	泓德泓利货币	
基金主代码	002184	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月21日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,295,101,023.84份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德泓利货币A	泓德泓利货币B
下属分级基金的交易代码	002184	002185
报告期末下属分级基金的份 额总额	7,890,506.44份	2,287,210,517.40份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求保持基金资产安全性和较高流动性的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断，并结合各类资产的流动性特征、风险收益特征、估值水平等因素，决定基金资产在债券、银行存款等各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。同时本基金将积极运用利率品种投资策略、信用品种投资策略、期限配置策略、流动性管理策略等多种投资策略，力争在保持基金资产安全性和较高流动性的基础上，获取高于业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、

	混合型基金及股票型基金。
--	--------------

### 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		泓德基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	陆志俊
	联系电话	010-59850177	95559
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4009-100-888	95559
传真		010-59322130	021-62701216
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		100088	200120
法定代表人		王德晓	牛锡明

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	<a href="http://www.hongdefund.com">http://www.hongdefund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2016年		2015年12月21日-2015年12月31日	
	泓德泓利货币A	泓德泓利货币B	泓德泓利货币A	泓德泓利货币B
本期已实现收益	595,236.65	49,007,211.19	2,081.39	1,095,201.68
本期利润	595,236.65	49,007,211.19	2,081.39	1,095,201.68
本期净值收益率	2.3806%	2.6295%	0.0922%	0.0985%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末	
期末基金资产净值	7,890,506.44	2,287,210,517.40	3,229,088.70	2,391,762,106.84
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	2016年末		2015年末	
累计净值收益率	2.4751%	2.7306%	0.0922%	0.0985%

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，本期已实现与本期利润相等。
- 2、基金利润分配按日结转份额。

#### 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

阶段 (泓德泓利货币A)	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
过去三个月	0.6390%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	0.2987%	0.0016%

过去六个月	1.2132 %	0.0016 %	0.6805 %	0.0000 %	0.5327 %	0.0016 %
过去一年	2.3806 %	0.0017 %	1.3537 %	0.0000 %	1.0269 %	0.0017 %
自基金合同生效日起 至今（2015年12月21 日-2016年12月31日）	2.4751 %	0.0019 %	1.3944 %	0.0000 %	1.0807 %	0.0019 %

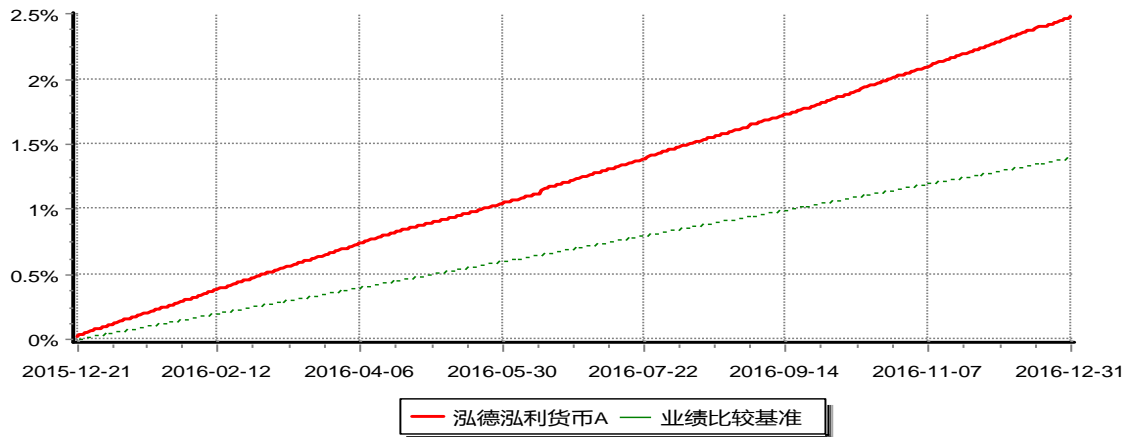
阶段 (泓德泓利货币B)	份额净 值收益 率①	份额净 值收益 率标准 差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比 较基准 收益率 标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.6998 %	0.0016 %	0.3403 %	0.0000 %	0.3595 %	0.0016 %
过去六个月	1.3362 %	0.0016 %	0.6805 %	0.0000 %	0.6557 %	0.0016 %
过去一年	2.6295 %	0.0017 %	1.3537 %	0.0000 %	1.2758 %	0.0017 %
自基金合同生效日起 至今（2015年12月21 日-2016年12月31日）	2.7306 %	0.0019 %	1.3944 %	0.0000 %	1.3362 %	0.0019 %



### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

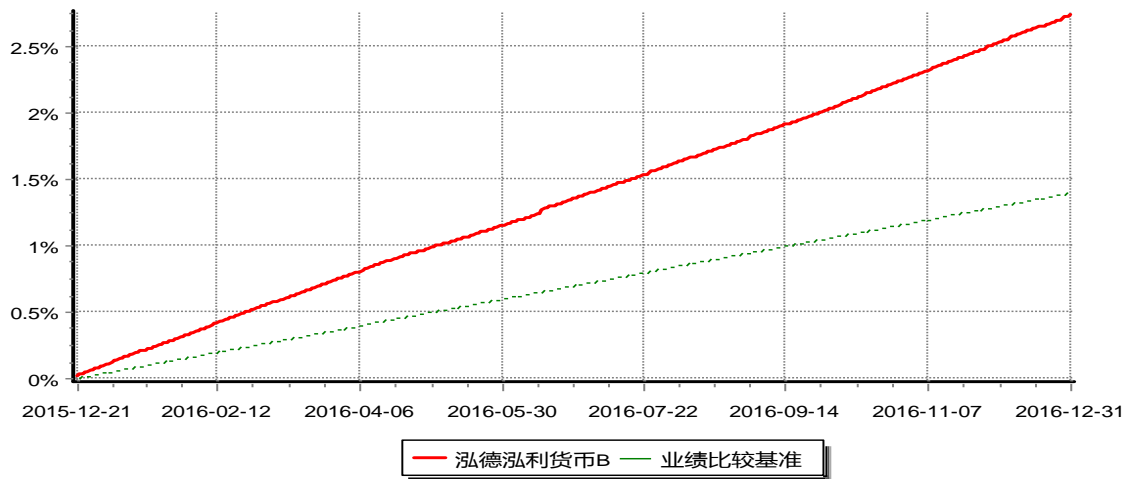
#### 泓德泓利货币A

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年12月21日-2016年12月31日)



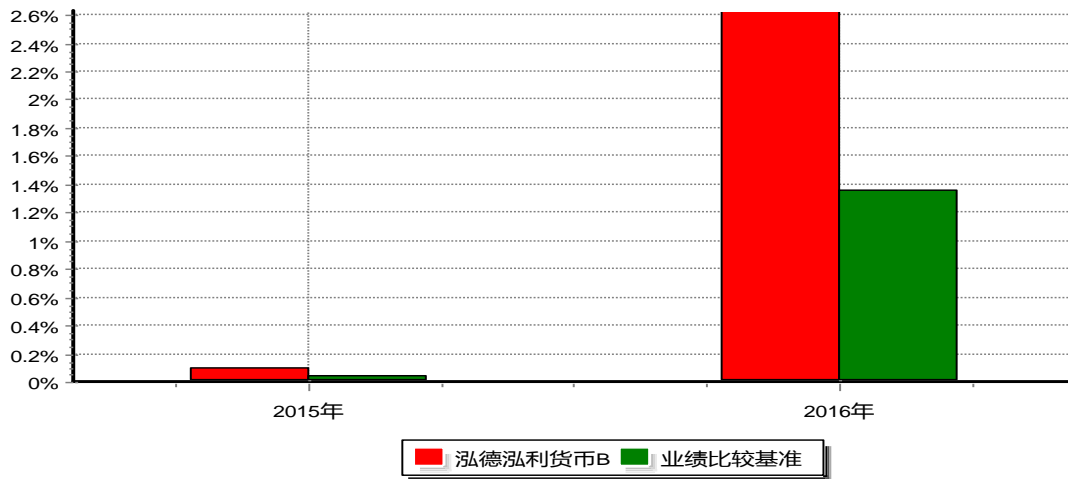
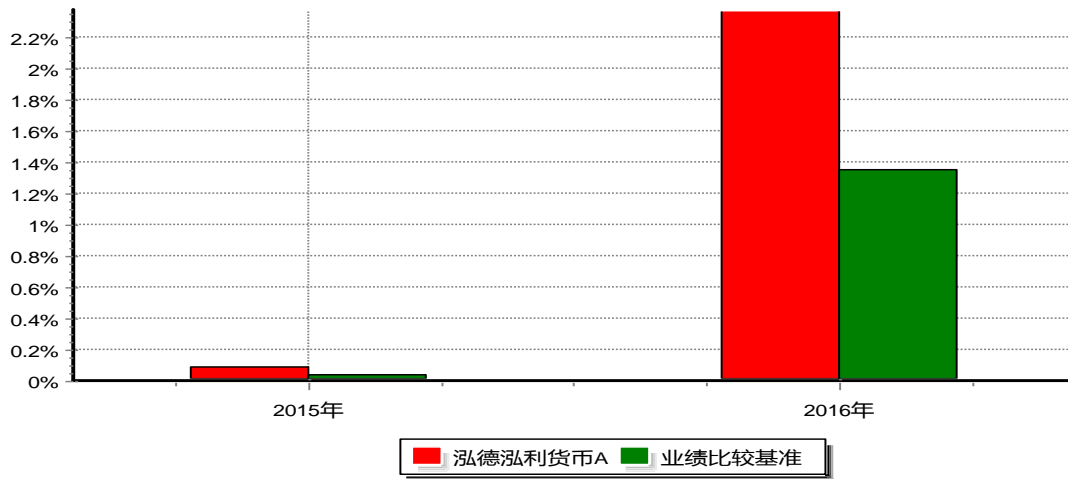
#### 泓德泓利货币B

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年12月21日-2016年12月31日)



注：建仓期结束后，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十二部分第二条投资范围、第四条投资限制的相关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金自2015年12月21日生效，生效当年净值增长率及业绩比较基准率按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

泓德泓利货币A

单位：人民币元

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2016年	594,757.54	—	479.11	595,236.65	
2015年	1,858.74	—	222.65	2,081.39	
合计	596,616.28	—	701.76	597,318.04	

泓德泓利货币B

单位：人民币元

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2016年	48,968,620.56	—	38,590.63	49,007,211.19	
2015年	915,376.80	—	179,824.88	1,095,201.68	
合计	49,883,997.36	—	218,415.51	50,102,412.87	

## §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

本基金基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的我国第一家由专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币12,000万元，公司注册地拉萨市。目前，公司股东及其出资比例为：王德晓26%，阳光保险集团股份有限公司25%，珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）16.667%，南京民生租赁股份有限公司13.875%，江苏岛村实业发展有限公司13.875%，上海捷朔信息技术有限公司4.583%。

截至2016年12月31日，公司总资产管理规模为299.98亿元，其中，公募基金管理规模179.56亿元，专户产品管理规模120.42亿元。2016年，公司发行了8只公募基金产品，包括混合型基金5只、债券型基金3只。自成立起至2016年12月31日，公司累计发行了15只公募基金产品：其中混合型基金9只，包括泓德优选成长混合、泓德泓富混合、泓德远见回报混合、泓德泓业混合、泓德泓益量化混合、泓德泓信混合、泓德泓汇混合、泓德泓华混合、泓德优势领航混合；股票型基金1只，具体为泓德战略转型股票；债券型基金4只，具体包括泓德裕泰债券、泓德裕康债券、泓德裕荣纯债、泓德裕和纯债；货币型基金1只，具体为泓德泓利货币。同时，公司管理多只特定客户资产管理计划。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邬传雁	公司副总经理、本基金、	2015年12月21日	—	16年	曾任幸福人寿保险股份有限公司总裁助理兼投资管理中心总经理、阳光保险集团股份有限公司资产投

	泓德泓富混合、泓德远见回报混合、泓德泓业混合、泓德裕泰债券基金经理				资管理中心投资负责人、阳光财产保险股份有限公司资金运用部总经理助理负责人、光大永明人寿保险公司投资部投资分析主管、光大证券股份有限公司研究所分析师、华泰财产保险公司投资管理中心基金部副经理。工商管理硕士，具有基金从业资格。
李倩	本基金、泓德泓富混合、泓德裕泰债券、泓德泓业混合、泓德裕康债券、泓德裕荣纯债、泓德裕和纯债基金经理	2015年12月21日	—	7年	曾任中国农业银行股份有限公司金融市场部、资产管理部理财组合投资经理；中信建投证券股份有限公司资产管理部债券交易员、债券投资经理助理。金融学硕士，具有基金从业资格。

注：①对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，"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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《泓德泓利货币市场基金基金合同》和其他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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《泓德基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，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《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年以来，央行总体维持了稳健的货币政策，从具体操作上综合运用公开市场操作、MLF等货币型政策工具稳定货币市场利率、采取有上下限的利率走廊调控，通过周期化的操作维持资金面的平衡，锁短放长。而在人民币贬值压力加大，外汇占款持续流出的背景下，体现在资金市场方面，则在3月、10月、12月等时点银行间资金面均有明显抽紧，金融机构负债成本提高，银行间拆借利率、同业存款和存单利率均大幅抬升。

2016年前三季度债市维持弹簧市窄幅震荡，10年国债收益率在2.6%-3%区间波动，而四季度市场迎来一轮深度调整，10年国债收益率最高攀升至3.4%，下跌始于10月中，由银行间流动性再度收紧而触发，此后进入11月中旬，在特朗普意外当选、短期经济有所企稳等多种外力因素作用下跌幅不断加深，直至12月下旬收益率曲线有所修复。从11月中旬至12月中旬的一个月期间，各品种、期限债券收益率全线大幅飚升，调整之剧烈超过4月份信用违约冲击那一轮。

本产品成立于2015年12月21日，产品以保证资产的流动性为首要任务，成立以来采取短久期策略，合理安排资金到期，在报告期安排了较大比例的流动性于月末、半年末等可能发生流动性紧张的时点操作，并抓住月末、半年末市场资金利率阶段性走高的机会，通过配置高息存款、存单以及优质短融提高组合收益率，在保证流动性安全的基础上提高了组合的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年，本基金A级净值收益率为2.3806%，B级净值收益率为2.6295%，同期业绩比较收益率为1.3537%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从货币政策看，中央经济工作会议中将货币政策定调由“稳健”转向“稳健中性”，提出“防控金融风险 and 资产泡沫”，考虑到央行将在国内经济和稳定汇率之间进行平衡，预计2017年货币上不会宽松，将继续采用周期化的OMO、MLF来维持市场资金面的平衡，资金利率中枢将有所上升，债市杠杆结构被动改善，国内资金面仍将呈紧平衡。在此背景下，未来关键时点短端仍将波动，将持续关注市场流动性风险。

从经济基本面方面来看，近几个月经济统计数据有企稳，企业盈利有所好转，市场对经济预期也与2016年上半年的反应截然相反，央行先后提高MLF和MOM的利率也是对经济好转的确认。另外，从中央经济工作会议的定调来看，提到了淡化经济增长，所以这方面如果市场对经济增长预期弱化，可能即使未来经济数据下来可能也不会从基本上太过强化债券牛。

机构行为方面，可能会存在一些与往年不太一致的影响逻辑。近年来机构行为，比如理财爆发性增长，15年开始委外迅速扩容，对债券市场一定程度上塑造了所谓资产荒的牛市。但是一方面今年10月以前委外利率越来越低，另一方面近期深幅调整后，会带来委外行业的出清和整合以及缩回银行体系。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善

程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 完善内控流程及制度。根据法律法规的出台及行业的要求，推动各业务单元更新、完善内部制度及业务流程。识别业务活动中的关键风险点，确定关键控制活动，持续完善内部控制措施。

(2) 务实完成日常法律事务的工作。完成了大量日常法律事务工作，对合同、协议等法律文件及实务运作中存在的法律风险进行识别及防范。

(3) 严守监管规定，防范合规风险。通过事前合规审核、持续优化合规监控系统、加强合规培训等方面，对业务活动中存在的合规风险进行识别及评估，完成各类合规管理工作。

(4) 优化稽核审计的标准化作业程序。报告期间监察稽核部门按计划完成了每个季度的定期稽核任务，检查内容基本覆盖公司各业务部门和业务环节，检查完成后出具监察稽核报告和建议书，并对整改情况进行跟踪。同时，梳理了业务及管理模块的风险控制矩阵及专项稽核标准化作业模版，提高审计工作的标准化程度。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，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和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理、督察长、研究部、监察稽核部、运营支持部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理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。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金按日分配收益，自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，并按月结转到投资人基金账户，使基金账面份额净值始终保持1.0000元。按照上述通知及基金合同的规定，2016年年度泓利货币A分配利润595,236.65元,泓利货币B分配利润49,007,211.19元。

#### 4.9 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

本报告期内本基金不存在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

报告期内，托管人在泓德泓利货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，泓德基金管理有限公司在泓德泓利货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润：595,236.65元，向B级份额持有人分配利润：49,007,211.19元。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

报告期内，由泓德基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泓德泓利货币市场基金的年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### §6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---



审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第20402号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泓德泓利货币市场基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的泓德泓利货币市场基金(以下简称"泓德泓利货币市场基金")的财务报表，包括2016年12月31日和2015年12月31日的资产负债表、2016年度和2015年12月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是泓德泓利货币市场基金的基金管理人泓德基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，</p>

	但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述泓德泓利货币基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了泓德泓利货币市场基金2016年12月31日和2015年12月31日的财务状况以及2016年度和2015年12月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞、赵钰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
审计报告日期	2017-03-24

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泓德泓利货币市场基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	804,008,467.84	1,867,808,245.94
结算备付金		430,000.00	146,330,000.00
存出保证金		—	—

交易性金融资产	7.4.7.2	864,429,351.43	—
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		864,429,351.43	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	600,051,900.08	380,000,000.00
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	7,319,307.10	1,141,995.52
应收股利		—	—
应收申购款		20,000,154.95	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	1,000.00	—
资产总计		2,296,240,181.40	2,395,280,241.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015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	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		15,477.27	—
应付管理人报酬		489,592.91	80,036.11
应付托管费		156,669.74	25,611.55
应付销售服务费		21,038.89	3,350.73
应付交易费用	7.4.7.7	29,238.25	—
应交税费		—	—
应付利息		—	—

应付利润		219,117.27	180,047.53
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	208,023.23	—
负债合计		1,139,157.56	289,045.92
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,295,101,023.84	2,394,991,195.54
未分配利润	7.4.7.10	—	—
所有者权益合计		2,295,101,023.84	2,394,991,195.54
负债和所有者权益总计		2,296,240,181.40	2,395,280,241.46

注：1.报告截止日2016年12月31日，泓德泓利货币市场基金基金份额净值为1.0000元，基金份额总额2,295,101,023.84份。其中泓德泓利货币市场基金A类份额7,890,506.44份，泓德泓利货币市场基金B类份额2,287,210,517.40份。（于2015年12月31日，泓德泓利货币市场基金基金份额净值为1.0000元，基金份额总额2,394,991,195.54份。其中泓德泓利货币市场基金A类份额3,229,088.70份，泓德泓利货币市场基金B类份额2,391,762,106.84份。）

2.本基金合同生效日为2015年12月21日，上年度财务报表的编制期间为2015年12月21日至2015年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：泓德泓利货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年12月21日至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>		58,133,299.14	1,209,081.46
1.利息收入		58,080,770.85	1,209,081.46
其中：存款利息收入	7.4.7.11	31,731,150.07	1,129,796.87
债券利息收入		18,979,596.43	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		7,370,024.35	79,284.59

其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		52,528.29	—
其中：股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.12	52,528.29	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	7.4.7.13	—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益		—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		—	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	—	—
<b>减：二、费用</b>		<b>8,530,851.30</b>	<b>111,798.39</b>
1. 管理人报酬		4,686,790.61	80,036.11
2. 托管费		1,499,772.95	25,611.55
3. 销售服务费		257,456.86	3,350.73
4. 交易费用	7.4.7.16	—	—
5. 利息支出		1,815,810.80	—
其中：卖出回购金融资产支出		1,815,810.80	—
6. 其他费用	7.4.7.17	271,020.08	2,800.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>49,602,447.84</b>	<b>1,097,283.07</b>
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>49,602,447.84</b>	<b>1,097,283.07</b>

注：本基金合同生效日为2015年12月21日，上年度财务报表的编制期间为2015年12月21日至2015年12月31日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泓德泓利货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,394,991,195.54	—	2,394,991,195.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		49,602,447.84	49,602,447.84
三、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）	-99,890,171.70	—	-99,890,171.70
其中：1.基金申购款	11,021,436,460.87	—	11,021,436,460.87
2.基金赎回款	-11,121,326,632.57	—	-11,121,326,632.57
四、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）	—	49,602,447.84	-49,602,447.84
五、期末所有者权益（基金净值）	2,295,101,023.84	—	2,295,101,023.84
项 目	上年度可比期间2015年12月21日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	242,821,128.84	—	242,821,128.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	1,097,283.07	1,097,283.07
三、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）	2,152,170,066.70	—	2,152,170,066.70

少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	2,352,684,881.58	—	2,352,684,881.58
2.基金赎回款	-200,514,814.88	—	-200,514,814.88
四、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）	—	-1,097,283.07	-1,097,283.07
五、期末所有者权益（基金净值）	2,394,991,195.54	—	2,394,991,195.54

注：本基金合同生效日为2015年12月21日，上年度财务报表的编制期间为2015年12月21日至2015年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王德晓

王德晓

李娇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

泓德泓利货币市场基金（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”）证监许可[2015]2650号《关于准予泓德泓利货币市场基金注册的批复》核准，由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集242,821,100.00元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2015）第1323号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德泓利货币市场基金基金合同》于2015年12月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为242,821,128.84份，其中认购资金利息折合28.84份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金根据基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量，对其持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额类别。本基金设A类和B类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，并单独公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。若A类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过500万份时，本基金登记机构自动将其在该基金账户持有的A类基金份额升级为B类基金份额，并自其升级后的下一个工作日起适用B类基金份额的费率。若B类基金份额持有

人在单个基金账户保留的基金份额低于500万份时，本基金登记机构自动将其在该基金账户持有的B类基金份额降级为A类基金份额，并自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓利货币市场基金基金合同》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：现金，通知存款，一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，短期融资券，剩余期限在397天以内（含397天）的债券、资产支持证券、中期票据，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款税后利率。

本财务报表由本基金的基金管理人泓德基金管理有限公司于2017年3月24日批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"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<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会(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》、《泓德泓利货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2016年度和2015年12月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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2016年12月31日和2015年12月31日的财务状况以及2016年度和2015年12月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要的会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2016年度2015年12月21日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金



对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法

计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(i)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.0000元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的A、B类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.0000元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	8,467.84	8,245.94
定期存款	804,000,000.00	1,867,800,000.00
其中：存款期限1-3个月	—	851,800,000.00
存款期限3个月及以上	804,000,000.00	296,000,000.00
存款期限1个月以内	—	720,000,000.00
其他存款	—	—
合计	804,008,467.84	1,867,808,245.94

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日			
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度

					(%)
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	864,429,351.43	862,347,000.00	-2,082,351.43	-0.0907
	合计	864,429,351.43	862,347,000.00	-2,082,351.43	-0.0907
项目		上年度末2015年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	—	—	—	—

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。

3、本基金上年度末未持有交易性金融资产。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	600,051,900.08	—
交易所市场	—	—
合计	600,051,900.08	—
项目	上年度末2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	—	—
交易所市场	380,000,000.00	—
合计	380,000,000.00	—

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	7.75	1.06
应收定期存款利息	3,999,250.40	1,027,299.23
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	427.50	69,715.80
应收债券利息	2,969,500.29	—
应收买入返售证券利息	350,121.16	44,979.43
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	—	—
合计	7,319,307.10	1,141,995.52

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
其他应收款	1,000.00	—
待摊费用	—	—
合计	1,000.00	—

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	—	—
银行间市场应付交易费用	29,238.25	—

合计	29,238.25	—
----	-----------	---

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	23.23	—
预提费用	208,000.00	—
合计	208,023.23	—

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 泓德泓利货币A

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,229,088.70	3,229,088.70
本期申购	695,667,774.65	695,667,774.65
本期赎回（以“-”号填列）	-691,006,356.91	-691,006,356.91
本期末	7,890,506.44	7,890,506.44

##### 7.4.7.9.2 泓德泓利货币B

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,391,762,106.84	2,391,762,106.84
本期申购	10,325,768,686.22	10,325,768,686.22
本期赎回（以“-”号填列）	-10,430,320,275.66	-10,430,320,275.66
本期末	2,287,210,517.40	2,287,210,517.40

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

## 7.4.7.10.1 泓德泓利货币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
上年度末	—	—	—
本期利润	595,236.65	—	595,236.65
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	-595,236.65	—	-595,236.65
本期末	—	—	—

## 7.4.7.10.2 泓德泓利货币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
上年度末	—	—	—
本期利润	49,007,211.19	—	49,007,211.19
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	-49,007,211.19	—	-49,007,211.19
本期末	—	—	—

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年12月21日至2015年12月31日
活期存款利息收入	8,313.36	1.13
定期存款利息收入	31,502,251.92	1,027,299.23
其他存款利息收入	—	—



结算备付金利息收入	214,588.40	102,496.51
其他	5,996.39	—
合计	31,731,150.07	1,129,796.87

#### 7.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年12月21日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,491,711,341.01	—
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,477,670,985.92	—
减：应收利息总额	13,987,826.80	—
买卖债券差价收入	52,528.29	—

#### 7.4.7.15 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间未产生其他收入。

#### 7.4.7.16 交易费用

本基金本报告期及上年度可比期间未产生交易费用。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年12月21日至2015年12月31日
审计费用	99,000.00	—
信息披露费	100,000.00	—
其他	800.00	—
帐户维护费	33,000.00	—
开户费	400.00	—

汇划手续费	37,820.08	2,800.00
合计	271,020.08	2,800.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须做说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《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[2016]140号)，要求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，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
王德晓	基金管理人股东
阳光保险集团股份有限公司	基金管理人股东
珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）	基金管理人股东
南京民生租赁股份有限公司	基金管理人股东
江苏岛村实业发展有限公司	基金管理人股东

上海捷朔信息技术有限公司	基金管理人股东
--------------	---------

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间2015年12月 21日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,686,790.61	80,036.11
其中：支付销售机构的客户维护费	24,770.76	10.35

注：1、本基金合同生效日为2015年12月21日，上年度可比区间是指2015年12月21日至2015年12月31日。

2、支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%的年费率每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值X 0.25% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间2015年12月 21日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,499,772.95	25,611.55

注：

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数。

## 7.4.10.2.3 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 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德泓利货币A	泓德泓利货币B	合计
泓德基金	14,566.86	183,969.72	198,536.58
交通银行	504.65	—	504.65
合计	15,071.51	183,969.72	199,041.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年12月21日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德泓利货币A	泓德泓利货币B	合计
泓德基金	133.58	3,195.23	3,328.81
交通银行	16.81	—	16.81
合计	150.39	3,195.23	3,345.62

注：支付销售机构的A类基金份额销售服务费按前一日A类基金份额的基金资产净值0.25%的年费率计提，B类基金份额销售服务费按前一日B类基金份额的基金资产净值0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

A类日销售服务费=前一日A类基金份额基金资产净值X 0.25%/当年天数；

B类日销售服务费=前一日B类基金份额基金资产净值X 0.01%/当年天数。

## 7.4.10.3 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通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间2015年12月 21日至2015年12月31日

	泓德泓利货币 A	泓德泓利货 币B	泓德泓利货币 A	泓德泓利货 币B
基金合同生效日持有的基金份额	—	—	—	41,000,000.00
期初持有的基金份额	—	41,000,000.00	—	41,000,000.00
期间申购/买入总份额	—	240,066,245.19	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	223,700,000.00	—	—
期末持有的基金份额	—	57,366,245.19	—	41,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	2.50%	—	1.71%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 基金管理人泓德基金管理有限公司在本年度及上年度可比期间认购/申购/赎回本基金的交易委托直销柜台办理，本基金认购/申购/赎回不收取手续费。

#### 7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度可比期间末无其他关联方持有本基金的情况。

#### 7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间2015年12月21日 至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	8,467.84	8,313.36	8,245.94	1.13
交通银行-定期存款	—	450,619.45	—	—

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 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在承销期内未参与关联方承销证券。

**7.4.10.7 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无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

泓德泓利货币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
594,757.54	—	479.11	595,236.65	

泓德泓利货币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
48,968,620.56	—	38,590.63	49,007,211.19	

**7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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/增发的流通受限证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

**7.4.13 金融工具风险及管理****7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中由金融工具产生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争取将以上风险控制在限定的范围之内，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。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 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的发行人出现违约、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和部分定期存款存放在本基金的托管行交通银行股份有限公司；其他定期存款存放在具有基金托管资格的江苏银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司和恒丰银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

##### 7.4.13.2.1 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	上年度末
--------	-----	------

	2016年12月31日	2015年12月31日
A-1	9,981,182.15	—
A-1以下	—	—
未评级	764,074,173.50	—
合计	774,055,355.65	—

注：未评级部分为超短期融资券、同业存单、政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
AAA	—	—
AAA以下	—	—
未评级	90,373,995.78	—
合计	90,373,995.78	—

注：未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还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，除发生巨额赎回，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

于2016年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以



内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2016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	774,008,467.84	30,000,000.00	—	—	—	804,008,467.84
结算备付金	430,000.00	—	—	—	—	430,000.00
交易性金融资产	794,260,208.33	70,169,143.10	—	—	—	864,429,351.43
买入返售金融资产	600,051,900.08	—	—	—	—	600,051,900.08
应收利息	—	—	—	—	7,319,307.10	7,319,307.10
应收申购款	—	—	—	—	20,000,154.95	20,000,154.95

其他资产	—	—	—	—	1,000.00	1,000.00
资产总计	2,168,750, 576.25	100,169,1 43.10	—	—	27,320,46 2.05	2,296,240, 181.40
负债						
应付赎回款	—	—	—	—	15,477.27	15,477.27
应付管理人 报酬	—	—	—	—	489,592.9 1	489,592.9 1
应付托管费	—	—	—	—	156,669.7 4	156,669.7 4
应付销售服 务费	—	—	—	—	21,038.89	21,038.89
应付交易费 用	—	—	—	—	29,238.25	29,238.25
应付利润	—	—	—	—	219,117.2 7	219,117.2 7
其他负债	—	—	—	—	208,023.2 3	208,023.2 3
负债总计	—	—	—	—	1,139,157. 56	1,139,157. 56
利率敏感度 缺口	2,168,750, 576.25	100,169,1 43.10	—	—	26,181,30 4.49	2,295,101, 023.84
上年度末 2015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	1,867,808, 245.94	—	—	—	—	1,867,808, 245.94
结算备付金	146,330,0 00.00	—	—	—	—	146,330,0 00.00
买入返售金 融资产	380,000,0 00.00	—	—	—	—	380,000,0 00.00
应收利息	—	—	—	—	1,141,995. 52	1,141,995. 52

资产总计	2,394,138,245.94	—	—	—	1,141,995.52	2,395,280,241.46
负债						
应付管理人报酬	—	—	—	—	80,036.11	80,036.11
应付托管费	—	—	—	—	25,611.55	25,611.55
应付销售服务费	—	—	—	—	3,350.73	3,350.73
应付利润	—	—	—	—	180,047.53	180,047.53
负债总计	—	—	—	—	289,045.92	289,045.92
利率敏感度缺口	2,394,138,245.94	—	—	—	852,949.60	2,394,991,195.54

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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2016年12月31日	上年度末2015年12月31日
	市场利率下降25个基点	211,766.37	—
	市场利率上升25个基点	-211,426.89	—

注：本基金于2015年12月31日未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为864,429,351.43元，无属于第一或第三层次的余额(2015年12月31日：本基金未持有交易性金融资产)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	864,429,351.43	37.65
	其中：债券	864,429,351.43	37.65
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	600,051,900.08	26.13
	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	804,438,467.84	35.03
4	其他各项资产	27,320,462.05	1.19
5	合计	2,296,240,181.40	100.00

注：本报告期内，根据流动性管理的需要，本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

## 8.2 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	3.98	
	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	—	—

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基金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

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本基金本报告期内平均剩余期限未超过120天。

### 8.3.2 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	28.34	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	10.83	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	34.52	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	13.05	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天（含）	12.11	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	98.86	—

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本基金本报告期内平均剩余存续期未超过240天。

### 8.5 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	摊余成本	占基金资产
----	------	------	-------

			净值比例 (%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	120,356,690.38	5.24
	其中：政策性金融债	120,356,690.38	5.24
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	39,967,078.03	1.74
6	中期票据	—	—
7	同业存单	704,105,583.02	30.68
8	其他	—	—
9	合计	864,429,351.43	37.66
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

#### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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)	摊余成本	占基金资产净值 比例 (%)
1	111697893	16南京银行CD112	1,700,000	168,836,435.44	7.36
2	111680855	16广州农村商业银行CD153	800,000	79,571,998.92	3.47
3	111680565	16广州农村商业银行CD151	500,000	49,755,904.51	2.17
4	111680612	16厦门银行CD154	500,000	49,755,904.51	2.17
5	111680778	16江西银行CD070	500,000	49,744,360.54	2.17
6	111697613	16九江银行CD071	500,000	49,662,892.82	2.16

7	1116979 54	16苏州银行 CD121	500,000	49,656,167.31	2.16
8	1116040 21	16中行CD021	500,000	49,540,200.56	2.16
9	1116191 93	16恒丰银行 CD193	500,000	49,344,683.22	2.15
10	1116979 95	16东莞农村商 业银行CD078	500,000	48,921,517.99	2.13

### 8.7 “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	—
报告期内偏离度的最高值	0.0759
报告期内偏离度的最低值	-0.2233
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0340

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到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

注：本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.50%的情况。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明。

本基金的债券投资采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

**8.9.2** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

#### 8.9.3 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	应收证券清算款	—
3	应收利息	7,319,307.10
4	应收申购款	20,000,154.95
5	其他应收款	1,000.00
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	27,320,462.05

#### 8.9.4 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，分项之和与合计可能有尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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
泓德泓 利货币 A	405	19,482.73	3,604,462.6 8	45.68%	4,286,043.7 6	54.32%
泓德泓 利货币 B	33	69,309,409. 62	2,287,210,5 17.40	100.00 %	—	—
合计	438	5,239,956.6 8	2,290,814,9 80.08	99.81%	4,286,043.7 6	0.19%

注：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）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	泓德泓利货币A	802,422.79	10.1695%
	泓德泓利货币B	—	—
	合计	802,422.79	0.0350%

## 9.3 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	泓德泓利货币A	0
	泓德泓利货币B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德泓利货币A	0
	泓德泓利货币B	0
	合计	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泓德泓利货币A	泓德泓利货币B
基金合同生效日(2015年12月21日)基金份额总额	1,821,128.84	241,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,229,088.70	2,391,762,106.84
本报告期期间基金总申购份额	695,667,774.65	10,325,768,686.22
减：本报告期期间基金总赎回份额	691,006,356.91	10,430,320,275.66
本报告期期间基金拆分变动份额	—	—

本报告期期末基金份额总额	7,890,506.44	2,287,210,517.40
--------------	--------------	------------------

注：总申购份额含转换入份额、红利再投份额及基金份额自动升级调增份额，总赎回份额含转换出份额及基金份额自动降级调减份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

#### (1) 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人于2016年5月10日发布公告，经泓德基金管理有限公司董事会审议，聘任温永鹏先生为公司副总经理。

公司已根据相关法律法规要求，在指定媒体公开披露了公司人员的变更信息，并已在监管机构备案。

#### (2) 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，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。本报告期应支付给该会计师事务所的报酬99,000元，已连续为本基金提供审计服务2年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何监管部门的稽查和处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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		债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际证券	2	—	—	—	—	593,000,000.00	100.00%	—	—	
中信证券	3	—	—	—	—	—	—	—	—	
天风证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资历雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 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。

(6) 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公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究部、投资部等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进

行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每季度对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

## 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## 11.9 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	关于旗下部分基金增加申万宏源证券为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-08
2	泓德基金关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-08
3	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金最低赎回份额和最低保有份额限制的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-29
4	泓德泓利货币市场基金2016年春节假期前暂停大额申购（含定期定额申购及转换转入）业务的公告	公司官网、中国证券报	2016-02-01
5	关于旗下基金增加杭州数米基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-02-29
6	关于旗下基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-03-01
7	关于旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-03-04
8	关于旗下基金增加申万宏源西部证券有限公司为销售机构及开通定投和转	公司官网、中国证券报	2016-04-14

	换业务并参与其费率优惠的公告		
9	泓德泓利货币市场基金2016年第1季度报告	公司官网、中国证券报	2016-04-20
10	关于旗下基金增加平安证券有限责任公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-28
11	关于旗下部分基金在首创证券有限责任公司开通定投和转换业务的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
12	关于旗下基金增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为销售机构及开通定投业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
13	关于旗下基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
14	关于旗下基金增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
15	关于旗下基金增加珠海盈米财富管理有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
16	泓德基金管理有限公司关于旗下基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-12
17	关于旗下基金增加北京创金启富投资管理有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-25
18	关于旗下基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-25
19	泓德泓利货币市场基金2016年第2季度报告	公司官网、中国证券报	2016-07-21
20	关于旗下基金增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的	公司官网、中国证券报	2016-08-01

	公告		
21	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金在指定销售机构申（认）购、定投金额限制以及费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-08-04
22	关于旗下基金增加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-08-04
23	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金在指定销售机构费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-08-10
24	泓德泓利货币市场基金2016年半年度报告	公司官网、中国证券报	2016-08-27
25	泓德泓利货币市场基金2016年半年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2016-08-27
26	关于网上交易系统增加快捷支付方式并实施费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-09-01
27	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金在北京创金启富投资管理有限公司申（认）购、定投数额限制的公告	公司官网、中国证券报	2016-09-06
28	泓德基金管理有限公司关于网上直销开通汇款交易的公告	公司官网、中国证券报	2016-09-10
29	关于旗下基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构及开通转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-09-14
30	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金在指定销售机构申（认）购、定投数额限制的公告	公司官网、中国证券报	2016-09-21
31	关于旗下基金增加乾道金融信息服务（北京）有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-10-20
32	关于旗下基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构及参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-10-20
33	关于旗下基金增加深圳众禄金融控股股份有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-10-20

34	关于旗下基金增加大泰金石投资管理有限公司为销售机构及开通转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-10-24
35	泓德泓利货币市场基金2016年第3季度报告	公司官网、中国证券报	2016-10-25
36	关于旗下基金增加国都证券股份有限公司为销售机构及开通转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-11-04
37	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	公司官网、中国证券报	2016-11-17
38	关于旗下基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2016-12-09
39	关于旗下基金增加北京格上富信投资顾问有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-12-20
40	关于旗下基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-12-20
41	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京肯特瑞财富投资管理有限公司开通定投业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-12-20

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德泓利货币市场基金设立的文件；
- 2、《泓德泓利货币市场基金基金合同》；
- 3、《泓德泓利货币市场基金招募说明书》；
- 4、《泓德泓利货币市场基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处



### 12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888
- (3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.hongdefund.com](http://www.hongdefund.com)

泓德基金管理有限公司  
二〇一七年三月二十八日