

# 泓德添利货币市场基金

## 2017 年年度报告摘要

2017 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:中国民生银行股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 27 日

## § 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料经审计，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 2017 年 5 月 4 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	泓德添利货币	
基金主代码	003997	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年05月04日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	391,017,520.32份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德添利货币A	泓德添利货币B
下属分级基金的交易代码	003997	003998
报告期末下属分级基金的份额总额	140,084,218.43份	250,933,301.89份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越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。同时本基金将综合运用利率预期策略、信用品种投资策略、期限配置策略、收益增强策略、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		中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李晓春	罗菲菲
	联系电话	010-59850177	010-58560666
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话	4009-100-888		95568
传真	010-59322130		010-58560798

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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	本期2017年05月04日（基金合同生效日）- 2017年12月31日	
	泓德添利货币A	泓德添利货币B
本期已实现收益	847,633.75	10,068,078.08
本期利润	847,633.75	10,068,078.08
本期净值收益率	2.5423%	2.7036%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	
期末基金资产净值	140,084,218.43	250,933,301.89
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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、本基金基金合同生效日为2017年5月4日，本年度财务报表的实际编制期间为2017年5月4日至2017年12月31日。

### 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

#### 泓德添利货币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
过去三个月	1.0267%	0.0072%	0.3403%	0.0000%	0.6864%	0.0072%
过去六个月	2.0027%	0.0051%	0.6805%	0.0000%	1.3222%	0.0051%
自基金合同生效 起至今	2.5423%	0.0046%	0.8951%	0.0000%	1.6472%	0.0046%

#### 泓德添利货币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
过去三个月	1.0863%	0.0072%	0.3403%	0.0000%	0.7460%	0.0072%
过去六个月	2.1245%	0.0051%	0.6805%	0.0000%	1.4440%	0.0051%
自基金合同生效 起至今	2.7036%	0.0046%	0.8951%	0.0000%	1.8085%	0.0046%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。

本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

### 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

泓德添利货币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

(2017年05月04日-2017年12月31日)



泓德添利货币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

(2017年05月04日-2017年12月31日)



注：1) 本基金的基金合同于 2017 年 5 月 4 日生效，截至 2017 年 12 月 31 日止，本基金成立未满 1 年。  
2) 根据基金合同的约定，本基金建仓期为 6 个月，截至报告日，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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同自 2017 年 5 月 4 日生效，生效当年净值增长率及业绩比较基准收益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

泓德添利货币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
2017年	830,140.08	-	17,493.67	847,633.75	-
合计	830,140.08	-	17,493.67	847,633.75	-

泓德添利货币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
2017年	10,035,091.84	-	32,986.24	10,068,078.08	-
合计	10,035,091.84	-	32,986.24	10,068,078.08	-

## § 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：王德晓先生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2017年12月31日，公司总资产管理规模为365.52亿元，其中，公募基金管理规模167.85亿元，专户产品管理规模197.67亿元。2017年，公司新发行5只公募基金产品，包括混合型基金1只、债券型基金3只、货币型基金1只。自成立起至2017年12月31日，公司累计发行了20只公募基金产品：其中混合型10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、泓德致远混合；股票型基金1只，具体为泓德战略转型股票；债券型基金7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、泓德裕祥债券、泓德裕泽一年定开债券、泓德裕鑫一年定开债券；货币基金2只，具体为泓德泓利货币、泓德添利货币。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（助	证券从	说明
----	----	-------------	-----	----

		理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
李倩	本基金、泓德泓利货币、泓德裕泰债券、泓德泓富混合、泓德泓业混合、泓德裕康债券、泓德裕荣纯债、泓德裕和纯债、泓德裕祥债券、泓德裕泽一年定开债券、泓德裕鑫一年定开债券、泓德泓华混合基金经理	2017-05-04	-	8年	硕士研究生，具有基金从业资格，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。

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遵规守信情况的说明

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、《泓德添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的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年货币政策由中性转为稳健中性，资金面较2016年整体收紧，公开市场操作利率多次上调，其意义是在市场资金利率已经大幅上行的情况下，实现公开市场货币政策工具利率的随行就市。总体来看，2017年银行超储率水平低位的背景下，市场资金面稳中偏紧，并在关键时点出现明显的资金结构不平衡，对非银机构形成较大的资金扰动。

2017年债市经历了持续调整的一年，经济基本面的纠结，伴随着金融产品去杠杆、资管业统一监管相关的金融监管和改革政策的趋严，全年10年期国债上行从3.01%上行88BP至3.89%，10年期国开债从3.68%上行117BP至4.85%。2017年一季度，经济基本面小幅回暖、美联储加息、我国央行上调货币政策操作利率，使得一季度资金利率和债市长端收益率上行明显；二季度债市主要在监管政策集中发布的影响下大幅调整，悲观情绪浓厚；三季度经济数据表现整体弱于上半年，监管政策悬而未决，市场缺乏明确方向，波动收窄；四季度债券市场再次聚焦监管，在监管形势不明朗的背景下，市场情绪极度脆弱，受悲观预期主导的债市脱离基本面、资金面走势，连续调整。

本基金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、季度末等可能发生流动性紧张的时点操作，并抓住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

2017年，泓德添利货币A基金净值收益率为2.5423%，泓德添利货币B基金净值收益率为2.7036%，同期业绩比较收益率为0.8951%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在基本面尚未明显走弱，金融监管仍可能加强的大背景下，央行会继续货币与监管并行，货币政策短期缺乏转向的基础，在稳健中性的基础上继续保持边际趋紧是保证金融严监管的重要前提。鉴于货币政策仍将维持稳中偏紧的基调，基础货币的投放及操作节奏不会有太大变化，而在超储率低位及央行精准调控以维护系统稳定的背景下，流动性冲击常有而“钱荒”不再有，预计不会出现流动性过度收紧而造成市场的过渡动荡。

监管政策方面，2017年11月中旬，资管新政征求意见稿落地，随着新规的发布，资管业务将进入规范发展的通道，后续资管行业将逐步向统一监管、统一标准、统一市场、公平竞争的方向发展，目前的市场实际是一个上下游相互依赖的产业链，而非平层竞争类市场。2018年上半年预计将迎来各项监管政策的细则，所有影子银行、广义基金都将围绕资管环境的变化而受影响，后期随着监管细则的落地和明朗化，当前谨慎的市场情绪会逐步缓解，后期将密切关注金融市场对监管冲击的反映是否完全。

经济基本面方面，2017年四季度投资趋势回落、工业增加值低位徘徊的格局没有改变，从经济增长的几大带动因素看，2018年经济支撑力主要来自于新动能中的消费和服务业，下拉力主要来自出口和投资。具体来看，海外经济弱复苏叠加价格的大幅回落将带来出口增速的回落；房地产销售大幅回落，房地产投资增速小幅回落；金融监管叠加地方政府去杠杆大背景下，基建很难有所拉动。

从经济基本面的角度来看，当前收益率水平已处在历史相对高位，具备一定的吸引力，但考虑到监管政策对结构性和流动性的影响，短期主要仍以防御为主，后期产品策略的调整节奏将充分考虑监管政策对市场的影响。

投资策略上，本基金将风险控制放在组合管理的第一位，严格控制组合流动性风险，信用风险和价格风险，继续维持较高仓位的银行同业存款及同业存单投资，同时适当配置高评级短期融资券。基于对基金投资环境的分析，动态调整组合资产配置，结合市场利率走势调节组合久期，在风险可控的基础上，为持有人创造稳健的收益。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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，并按日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，2017年年度添利货币A分配利润847,633.75元，添利货币B分配利润10,068,078.08元。

#### 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

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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金向A级份额持有人分配利润：847,633.75元，向B级份额持有人分配利润：10,068,078.089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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师薛竞、赵钰于2018年3月23日对本基金2017年12月31日的资产负债表、2017年度利润表、所有者权益（基金净值）

变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2018)第21765号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泓德添利货币市场基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	137,004,396.35
结算备付金		480,000.00
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	217,348,311.91
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		217,348,311.91
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	34,028,791.04
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	2,322,612.58
应收股利		-
应收申购款		157,347.60
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		391,341,459.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017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		1,299.82
应付管理人报酬		122,165.93
应付托管费		24,433.20
应付销售服务费		51,687.52
应付交易费用	7.4.7.7	16,272.60
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		50,479.91
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	57,600.18
负债合计		323,939.16
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	391,017,520.32
未分配利润	7.4.7.10	-
所有者权益合计		391,017,520.32
负债和所有者权益总计		391,341,459.48

注：1、报告截止日2017年12月31日，泓德添利货币市场基金基金份额净值为1.0000元，基金份额总额391,017,520.32份。其中泓德添利货币市场基金A类份额140,084,218.43份，泓德添利货币市场基金B类份额250,933,301.89份。

2、本财务报表的实际编制期间为2017年05月04日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：泓德添利货币市场基金

本报告期：2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日
----	-----	------------------------------------

一、收入		12,471,384.17
1. 利息收入		12,471,384.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,686,298.82
债券利息收入		5,907,602.99
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,877,482.36
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
<b>减：二、费用</b>		1,555,672.34
1. 管理人报酬		667,506.74
2. 托管费		133,501.36
3. 销售服务费		77,321.66
4. 交易费用	7.4.7.18	-
5. 利息支出		533,223.60
其中：卖出回购金融资产支出		533,223.60
6. 其他费用	7.4.7.19	144,118.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,915,711.83
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,915,711.83

注：本财务报表的实际编制期间为2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日止期间，无上年度可比期间。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泓德添利货币市场基金

本报告期：2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年05月04日（基金合同生效日）至2017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)	234,143,252.7 1	-	234,143,252.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,915,711.83	10,915,711.83
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）	156,874,267.6 1	-	156,874,267.61
其中：1. 基金申购款	1,218,844,27 1.02	-	1,218,844,271.02
2. 基金赎回款	-1,061,970,00 3.41	-	-1,061,970,003.41
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）	-	-10,915,711.8 3	-10,915,711.83
五、期末所有者权益（基金净值）	391,017,520.3 2	-	391,017,520.32

注：本财务报表的实际编制期间为2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日止期间，无上年度可比期间。

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

泓德添利货币市场基金（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[2016]2286号《关于准予泓德添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《泓德添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234,131,500.00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（2017）第488号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德添利货币市场基金基金合同》于2017年5月4日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为234,143,252.71份，其中认购资金利息折合11,752.71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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《泓德添利货币市场基金招募说明书》，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，收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。A类基金份额：指按照0.25%年费率计提销售服务费的基金份额类别。B类基金份额：指按照0.01%年费率计提销售服务费的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德添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，期限在一年以内(含一年)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、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他流动性的货币市场工具。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2018年3月23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》、《泓德添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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年5月4日(基金合同生效日)至2017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2017年12月31日的财务状况以及2017年

5月4日(基金合同生效日)至2017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。本期财务报表的实际编制期间为2017年5月4日(基金合同生效日)至2017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：

(1)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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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1.00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，以及因级别调整而引起的A、B级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应取得的按票面利率或者发行价计算的利息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。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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1.00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，每日以红利再投资方式集中支付累计收益。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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：

对于在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》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固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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[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)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 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
中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）	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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	667,506.74
其中：支付销售机构的客户维护费	17,834.07

注：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%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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。

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	133,501.36

注：支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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 0.05% / 当年天数。

###### 7.4.8.2.3 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 2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德添利货币A	泓德添利货币B	合计
泓德基金	2,744.03	23,520.57	26,264.60
中国民生银行	458.08	-	458.08
合计	3,202.11	23,520.57	26,722.68

注：支付基金销售机构的销售服务费A类按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，B类按前一日基金资产净值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=前一日基金资产净值 X 0.25%/当年天数。

B类日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.01%/当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

泓德添利货币A

份额单位：份

项目	本期 2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日
基金合同生效日（2017年05月04日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-

泓德添利货币B

份额单位：份

项目	本期 2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日
基金合同生效日（2017年05月04日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	48,536,753.00
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-

报告期末持有的基金份额	48,536,753.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.41%

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在本年度申购本基金的交易委托直销柜台办理，本基金申购不收取手续费。

#### 7.4.8.4.2 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

份额单位：份

泓德添利货币A

关联方名称	本期末 2017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
阳光保险集团股份有限公司	16,485.63	-

注：本报告期末阳光保险集团股份有限公司持有本基金份额占总份额的比例为0.0042%。

#### 7.4.8.5 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 2017年05月04日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行--活期存款	4,396.35	4,776.52
中国民生银行--定期存款	76,000,000.00	1,483,940.70

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 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。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.10 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2017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217,348,311.91元，无属于第一层次或第三层次的余额。

##### (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2017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。

##### (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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入

固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外,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	217,348,311.91	55.54
	其中：债券	217,348,311.91	55.54
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	34,028,791.04	8.70
	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	137,484,396.35	35.13
4	其他各项资产	2,479,960.18	0.63
5	合计	391,341,459.48	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.39	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2017-08-17	25.20	规模变动	20170817(18号已恢复正常)
2	2017-12-19	22.38	规模变动	20171219(20号已恢复正常)

### 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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	-

#### 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	21.46	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	55.35	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.56	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	19.96	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.33	-

#### 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

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	49,997,737.65	12.79
	其中：政策性金融债	49,997,737.65	12.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	167,350,574.26	42.80
8	其他	-	-
9	合计	217,348,311.91	55.59
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)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111771940	17宁波银行CD250	300,000	29,891,943.19	7.64
2	111709524	17浦发银行CD524	300,000	29,266,497.14	7.48
3	111710684	17兴业银行CD684	300,000	29,258,236.42	7.48
4	110211	11国开11	200,000	20,008,920.82	5.12
5	170301	17进出01	200,000	19,992,073.47	5.11
6	111793272	17南京银行CD038	200,000	19,819,477.18	5.07
7	111716295	17上海银行CD295	200,000	19,527,451.37	4.99
8	170408	17农发08	100,000	9,996,743.36	2.56
9	111785579	17天津银行CD199	100,000	9,899,844.87	2.53
10	111785562	17贵阳银行CD141	100,000	9,898,895.63	2.53

### 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	0.1025%
报告期内偏离度的最低值	-0.0476%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0222%

#### 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

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。

### 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	2,322,612.58
4	应收申购款	157,347.60
5	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,479,960.18

#### 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
泓德添利货币A	6,988	20,046.40	325,074.23	0.23%	139,759,144.20	99.77%
泓德添利货币B	13	19,302,561.68	250,933,301.89	100.00%	0.00	-
合计	7,001	55,851.67	251,258,376.12	64.26%	139,759,144.20	35.74%

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)	持有份额占总份额的比例(%)
1	保险类机构	30,124,041.82	7.71
2	券商类机构	30,102,625.93	7.70
3	其他机构	30,000,000.00	7.67
4	基金类机构	20,790,870.13	5.32
5	其他机构	20,141,591.96	5.15
6	基金类机构	12,319,570.08	3.15
7	基金类机构	12,319,569.97	3.15
8	其他机构	12,192,870.19	3.12
9	券商类机构	10,002,351.75	2.56

10	券商类机构	10,002,351.75	2.56
----	-------	---------------	------

### 9.3 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	泓德添利货币A	81,475.72	0.0582%
	泓德添利货币B	0.00	0.0000%
	合计	81,475.72	0.0208%

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）。

### 9.4 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	泓德添利货币A	0~10
	泓德添利货币B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	泓德添利货币A	0~10
	泓德添利货币B	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德添利货币A	泓德添利货币B
基金合同生效日(2017年05月04日)基金份额总额	131,552.71	234,011,700.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	479,736,611.30	739,107,659.72
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	339,783,945.58	722,186,057.83
本报告期期末基金份额总额	140,084,218.43	250,933,301.89

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，本基金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，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 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48,600.00元，已连续为本基金提供审计服务1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，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到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		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	
国信证券	2	-	-	-	-	-

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) 资质雄厚，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务。

## 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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国信证券	-	-	206,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

投资者类别	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	1	2017/09/18-2017/09/26	-	99,308,994.95	93,000,000.00	6,308,994.95	1.61%
	2	2017/10/24-2017/10/30	-	107,173,284.60	107,173,284.60	-	-
	3	2017/11/02-2017/11/27	-	107,173,284.60	107,173,284.60	-	-
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，由于基金份额持有人占比相对集中，本基金可能存在集中赎回甚至巨额赎回而引起基金净值大幅波动的风险，甚至引发基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

泓德基金管理有限公司  
二〇一八年三月二十七日