

海富通添益货币市场基金
2021 年第 4 季度报告
2021 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通添益货币
基金主代码	004770
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 14 日
报告期末基金份额总额	56,612,394,783.97 份
投资目标	本基金在力争本金安全和保持基金资产较好流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金投资策略将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，力求将各类风险降到最低，在控制投资组合良好流动性的前提下为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率（税后）
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，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	海富通基金管理有限公司

基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通添益货币 A	海富通添益货币 B
下属两级基金的交易代码	004770	004771
报告期末下属两级基金的份额总额	1,583,276,506.30 份	55,029,118,277.67 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)	
	海富通添益货币 A	海富通添益货币 B
1. 本期已实现收益	8,468,294.34	339,833,811.06
2. 本期利润	8,468,294.34	339,833,811.06
3. 期末基金资产净值	1,583,276,506.30	55,029,118,277.67

注：（1）本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

（2）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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 海富通添益货币 A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5372%	0.0004%	0.0881%	0.0000%	0.4491%	0.0004%
过去六个月	1.0659%	0.0004%	0.1763%	0.0000%	0.8896%	0.0004%

过去一年	2.2150%	0.0006%	0.3500%	0.0000%	1.8650%	0.0006%
过去三年	6.9777%	0.0012%	1.0546%	0.0000%	5.9231%	0.0012%
自基金合同生效起至今	12.3775%	0.0029%	1.5443%	0.0000%	10.8332%	0.0029%

2. 海富通添益货币 B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5979%	0.0004%	0.0881%	0.0000%	0.5098%	0.0004%
过去六个月	1.1882%	0.0004%	0.1763%	0.0000%	1.0119%	0.0004%
过去一年	2.4607%	0.0006%	0.3500%	0.0000%	2.1107%	0.0006%
过去三年	7.7505%	0.0012%	1.0546%	0.0000%	6.6959%	0.0012%
自基金合同生效起至今	12.4921%	0.0034%	1.4248%	0.0000%	11.0673%	0.0034%

注：本基金收益分配为按日结转份额。

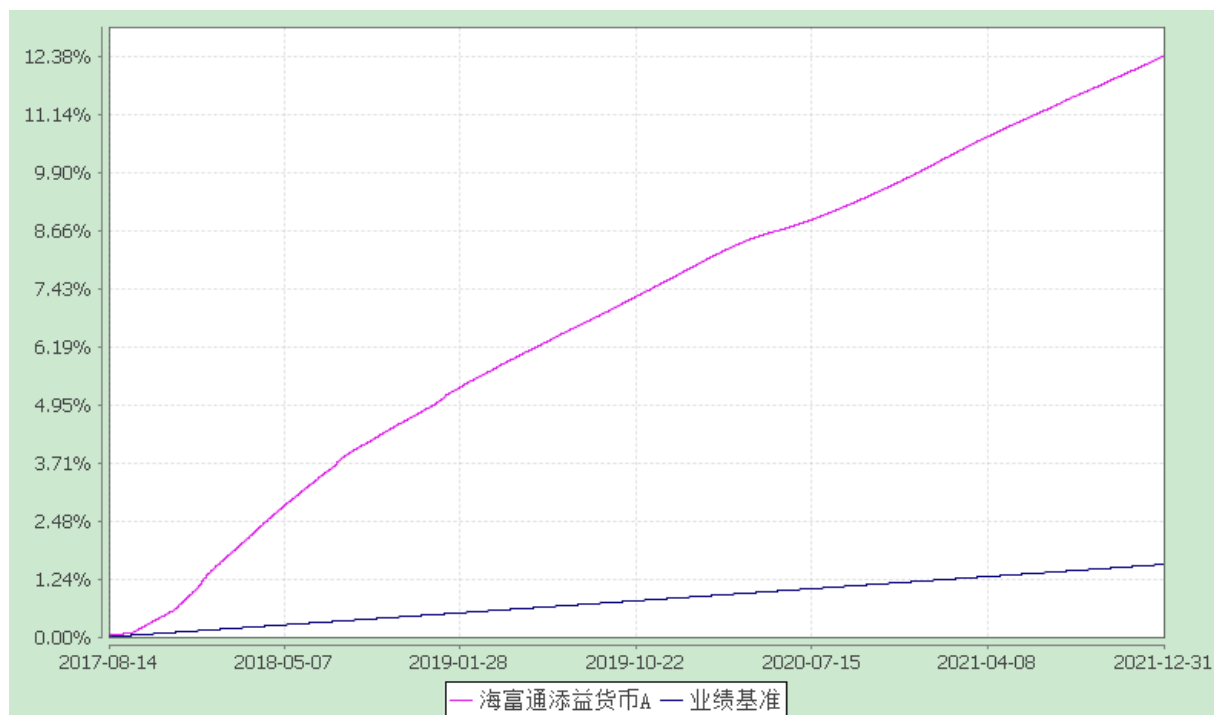
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通添益货币市场基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

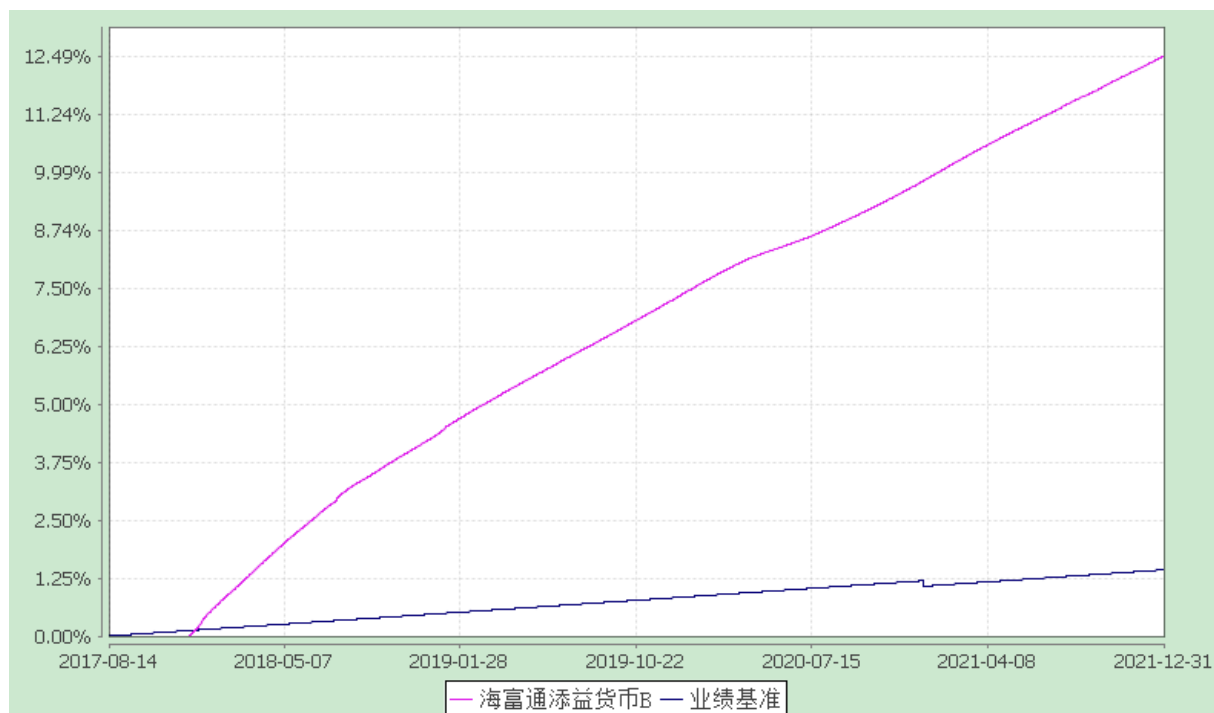
1. 海富通添益货币 A

(2017 年 8 月 14 日至 2021 年 12 月 31 日)



2. 海富通添益货币 B

(2017 年 8 月 14 日至 2021 年 12 月 31 日)



注：本基金合同于2017年8月14日生效，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何谦	本基金的基金经理；债券基金部副总监。	2017-08-14	-	11 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任平安银行资金交易员，华安基金管理有限公司债券交易员，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券基金部基金经理助理，现任债券基金部副总监。2016 年 5 月至 2017 年 10 月兼任海富通双利债券基金经理。2016 年 5 月起任海富通纯债债券的基金经理。2016 年 5 月至 2021 年 10 月兼任海富通可转债优选债券（原海富通双福债券）的基金经理。2016 年 5 月至 2019 年 12 月任海富通货币基金经理。2016 年 9 月至 2020 年 7 月担任海富通集利债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通添益货币基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 6 月任海富通聚丰纯债债券基金经理。2019 年 4 月至 2021 年 2 月任海富

					通稳健添利债券基金 经理。
--	--	--	--	--	------------------

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度国内经济有所走弱，债券收益率呈现震荡小幅下行。具体而言，10 月以来限电、能耗双控等不利因素消退，国内生产有所反弹，PMI 指标重新回到 50% 以上。但投资方面受到“贷款双集中”、“三道红线”监管、集中供地等政策的影响，同时以恒大为代表的风险事件在地产行业发酵蔓延，地产投资增速大幅回落，单月同比增速转负；同时基建投资增速在缺乏项目与年内缺乏托底经济的动力的情况下维持低位；制造业投资在中游出口需求较好、高技术产业投资旺盛的带动下表现强势。四季度消费在国内疫情局部反复的情况下表现较为疲软，尤其是线下消费与餐饮相关的行业受损严重。出口受到

海外经济复苏的支撑维持较好的韧性，其中机电产品出口表现亮眼。通胀方面，四季度 CPI 在猪肉价格企稳、蔬菜价格受极端天气影响的背景下有所上行，PPI 在煤炭保供限价的政策组合下见顶回落。在这种经济环境下，四季度货币政策继续维持宽松，12 月央行年度第 2 次降准 50bp，释放中长期资金约 1.2 万亿，此外还陆续推出碳减排支持工具、下调支农支小再贷款利率等结构性政策。对应债市而言，10 月宽货币落空而宽信用预期升温，债券到期收益率上行，最高达到 3.04% 的水平。11 月新冠变异毒株欧米克戎对资本市场的影响开始发酵，债券到期收益率震荡下行。12 月随着经济基本面走弱被进一步确认，在降准的带动下降息预期逐渐升温，10 年期国债到期收益率年底下行至 2.79% 的水平。整个四季度 10 年期国债收益率下行 10.2BP。

本基金四季度主动缩短了剩余期限，降低了债券和同业存单的占比，维持组合静态总体平稳，较好的应对了年末的负债波动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通添益货币 A 类基金净值收益率为 0.5372%，同期业绩比较基准收益率为 0.0881%。海富通添益货币 B 类基金净值收益率为 0.5979%，同期业绩比较基准收益率为 0.0881%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	5,628,670,889.00	9.93
	其中：债券	5,628,670,889.00	9.93
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	15,031,211,347.44	26.53
	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	35,189,105,282.07	62.11
4	其他资产	809,783,755.79	1.43

5	合计	56,658,771,274.30	100.00
---	----	-------------------	--------

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.23	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	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	-	-

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银行间市场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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	41
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	49.51	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	20.46	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	14.04	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	9.94	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	4.69	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.65	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	558,548,609.72	0.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,279,583,308.94	4.03
	其中：政策性金融债	2,279,583,308.94	4.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,790,538,970.34	4.93
8	其他	-	-
9	合计	5,628,670,889.00	9.94

10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-
----	----------------------	---	---

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	210201	21 国开 01	9,200,000	920,121,704.87	1.63
2	112176106	21 广州农村商业银行 CD147	5,000,000	494,277,362.64	0.87
3	190202	19 国开 02	4,600,000	460,156,329.53	0.81
4	2103689	21 进出 689	4,200,000	419,310,668.06	0.74
5	112187018	21 宁波银行 CD221	3,000,000	299,046,843.32	0.53
6	112116145	21 上海银行 CD145	3,000,000	299,040,746.27	0.53
7	112109190	21 浦发银行 CD190	2,500,000	247,480,091.20	0.44
8	219939	21 贴现国债 39	2,300,000	229,282,081.06	0.41
9	219955	21 贴现国债 55	2,100,000	209,433,121.96	0.37
10	2103688	21 进出 688	1,600,000	159,807,886.37	0.28

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.0049%
报告期内偏离度的最低值	-0.0023%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0016%

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%。

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0.5%。

5.8 报告期末按摊余成本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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

2007 年 7 月 1 日基金实施新会计准则后，本基金所持有的债券（包括票据）采用摊余成本法进行估值，即估值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。

5.9.2 报告期内本基金投资的 21 上海银行 CD145（112116145）的发行人，因 2018 年 12 月某笔同业投资房地产企业合规审查严重违反审慎经营规则，2019 年 11 月某笔经营性物业贷款授信后管理严重违反审慎经营规则，2019 年 2 月至 4 月部分个人贷款违规用于购房，2020 年 5 月至 7 月对部分个人住房贷款借款人偿债能力审查不审慎，2020 年 7 月在助贷环节对第三方机构收费管理严重违反审慎经营规则，2020 年 6 月至 12 月部分业务以贷收费等违规行为，于 2021 年 7 月 2 日被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款 460 万元。

对该证券的投资决策程序的说明:银行业整体信用水平高，且该银行为地区中大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的 21 进出 688、21 进出 689（2103688、2103689）的发行人，因违规投资企业股权、个别高管人员未经核准实际履职、监管数据漏报错报、违规向地方政府购买服务提供融资、违规变相发放土地储备贷款、向用地未获国务院批准的项目发放贷款等违规行为，于 2021 年 7 月 13 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚没 7345.6 万元的行政处罚。

对该证券的投资决策程序的说明:银行业整体信用水平高，且该银行为国家政策性银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的 21 浦发银行 CD190（112109190）的发行人，因 2016 年 5 月至 2019 年 1 月期间未按规定开展代销业务，于 2021 年 4 月 23 日被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正、并处以罚款 760 万元。因监管发现的问题屡查屡犯、配合现场检查不力、内部控制制度修订不及时、信息系统管控有效性不足、未向监管部门真实反映业务数据、净值型理财产品估值方法使用不准确、未严格执行理财投资合作机构名单制管理等违规行为，于 2021 年 7 月 13 日被中国银行保险监督管理委员会处罚罚款 6920 万元。

对该证券的投资决策程序的说明:银行业整体信用水平高,且该银行为全国大型银行,综合实力强,信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余六名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	29,743.75
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	367,624,502.31
4	应收申购款	442,129,509.73
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	809,783,755.79

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	海富通添益货币A	海富通添益货币B
本报告期期初基金份额总额	1,299,919,538.72	42,755,022,759.58
本报告期基金总申购份额	9,880,072,165.32	103,572,351,614.06
减:本报告期基金总赎回份额	9,596,715,197.74	91,298,256,095.97
本报告期期末基金份额总额	1,583,276,506.30	55,029,118,277.67

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额(元)	适用费率
----	------	------	-------------	---------	------

1	申购	2021-10-18	90,000,000.00	90,000,000.00	-
2	赎回	2021-10-21	45,000,000.00	45,002,839.43	-
3	申购	2021-10-27	5,000,000.00	5,000,000.00	-
4	申购	2021-11-04	55,000,000.00	55,000,000.00	-
5	赎回	2021-11-22	42,000,000.00	42,002,584.42	-
6	申购	2021-11-26	20,000,000.00	20,000,000.00	-
7	赎回	2021-12-16	172,000,000.00	172,012,118.25	-
8	赎回	2021-12-27	60,000,000.00	60,003,925.50	-
9	申购	2021-12-29	125,000,000.00	125,000,000.00	-
10	申购	2021-12-30	22,000,000.00	22,000,000.00	-
合计			636,000,000.00	636,021,467.60	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基

金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 106 只公募基金。截至 2021 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模超 1653 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通添益货币市场基金的文件
- (二)海富通添益货币市场基金基金合同
- (三)海富通添益货币市场基金招募说明书
- (四)海富通添益货币市场基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二二年一月二十二日