

---

# 泓德泓利货币市场基金

## 2021 年年度报告

2021 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:2022 年 03 月 30 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2022年3月29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2021年1月1日起至2021年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                         | 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、基金净值表现及利润分配情况                 | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 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                 | 15 |
| 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       | 15 |
| §5 托管人报告                                | 15 |
| 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                           | 16 |
| §7 年度财务报表                               | 19 |
| 7.1 资产负债表                               | 19 |
| 7.2 利润表                                 | 21 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 22 |
| 7.4 报表附注                                | 24 |
| §8 投资组合报告                               | 47 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 47 |
| 8.2 债券回购融资情况                            | 47 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限                        | 48 |
| 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         | 48 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 49 |
| 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      | 49 |
| 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离          | 50 |
| 8.8 期末按摊余成本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  | 50 |
| 8.9 投资组合报告附注                            | 50 |

|                                    |    |
|------------------------------------|----|
| §9 基金份额持有人信息                       | 52 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构              | 52 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况             | 52 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况           | 53 |
| 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   | 53 |
| §10 开放式基金份额变动                      | 53 |
| §11 重大事件揭示                         | 54 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议                   | 54 |
| 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   | 54 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼        | 54 |
| 11.4 基金投资策略的改变                     | 54 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况              | 54 |
| 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      | 54 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况             | 54 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况              | 55 |
| 11.9 其他重大事件                        | 56 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息                 | 57 |
| 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 | 57 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息                | 57 |
| §13 备查文件目录                         | 58 |
| 13.1 备查文件目录                        | 58 |
| 13.2 存放地点                          | 58 |
| 13.3 查阅方式                          | 58 |

## § 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      | 237,728,728.24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 | 2,431,817.35份   | 235,296,910.89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<br>负责人 | 姓名                 | 李晓春                       |
|             | 联系电话               | 010-59850177              |
|             | 电子邮箱               | lixiaochun@hongdefund.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 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号     |
| 办公地址        | 北京市西城区德胜门外大街125号   | 中国（上海）长宁区仙霞路18号           |
| 邮政编码        | 100088             | 200336                    |
| 法定代表人       | 王德晓                | 任德奇                       |

## 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》             |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.hongdefund.com |
| 基金年度报告备置地点          | 北京市西城区德胜门外大街125号   |

## 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） | 中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42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<br>期间数<br>据和指<br>标 | 2021年            |                    | 2020年            |                    | 2019年            |                    |
|--------------------------|------------------|--------------------|------------------|--------------------|------------------|--------------------|
|                          | 泓德泓利<br>货币A      | 泓德泓利<br>货币B        | 泓德泓利<br>货币A      | 泓德泓利<br>货币B        | 泓德泓利<br>货币A      | 泓德泓利<br>货币B        |
| 本期已<br>实现收<br>益          | 175,787.<br>15   | 6,924,23<br>6.14   | 148,386.<br>08   | 6,416,18<br>1.28   | 261,444.<br>18   | 8,915,47<br>6.58   |
| 本期利<br>润                 | 175,787.<br>15   | 6,924,23<br>6.14   | 148,386.<br>08   | 6,416,18<br>1.28   | 261,444.<br>18   | 8,915,47<br>6.58   |
| 本期净<br>值收益<br>率          | 1.7647%          | 2.0117%            | 1.6556%          | 1.9007%            | 2.2697%          | 2.5158%            |
| 3.1.2<br>期末数<br>据和指<br>标 | 2021年末           |                    | 2020年末           |                    | 2019年末           |                    |
| 期末基<br>金资产<br>净值         | 2,431,81<br>7.35 | 235,296,9<br>10.89 | 6,944,60<br>7.40 | 185,685,5<br>65.84 | 7,737,24<br>4.47 | 380,135,1<br>98.38 |
| 期末基<br>金份额<br>净值         | 1.0000           | 1.0000             | 1.0000           | 1.0000             | 1.0000           | 1.0000             |
| 3.1.3<br>累计期<br>末指标      | 2021年末           |                    | 2020年末           |                    | 2019年末           |                    |
| 累计净<br>值收益<br>率          | 16.2205%         | 17.9224%           | 14.2052%         | 15.5968%           | 12.3451%         | 13.4407%           |

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

## 泓德泓利货币A

| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去三个月          | 0.4120%      | 0.0007%             | 0.3403%            | 0.0000%                   | 0.0717% | 0.0007% |
| 过去六个月          | 0.8491%      | 0.0006%             | 0.6805%            | 0.0000%                   | 0.1686% | 0.0006% |
| 过去一年           | 1.7647%      | 0.0008%             | 1.3500%            | 0.0000%                   | 0.4147% | 0.0008% |
| 过去三年           | 5.7975%      | 0.0021%             | 4.0537%            | 0.0000%                   | 1.7438% | 0.0021% |
| 过去五年           | 13.4135%     | 0.0032%             | 6.7537%            | 0.0000%                   | 6.6598% | 0.0032% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 16.2205%     | 0.0030%             | 8.1481%            | 0.0000%                   | 8.0724% | 0.0030% |

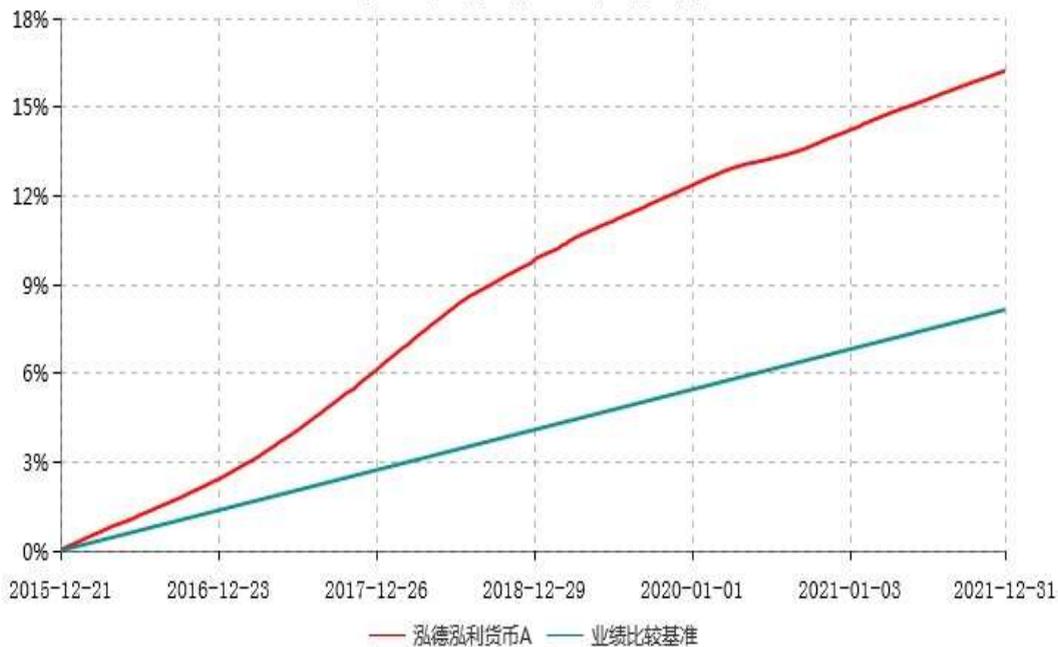
## 泓德泓利货币B

| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去三个月          | 0.4746%      | 0.0006%             | 0.3403%            | 0.0000%                   | 0.1343% | 0.0006% |
| 过去六个月          | 0.9731%      | 0.0006%             | 0.6805%            | 0.0000%                   | 0.2926% | 0.0006% |
| 过去一年           | 2.0117%      | 0.0008%             | 1.3500%            | 0.0000%                   | 0.6617% | 0.0008% |
| 过去三年           | 6.5659%      | 0.0021%             | 4.0537%            | 0.0000%                   | 2.5122% | 0.0021% |
| 过去五年           | 14.7880%     | 0.0032%             | 6.7537%            | 0.0000%                   | 8.0343% | 0.0032% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 17.9224%     | 0.0030%             | 8.1481%            | 0.0000%                   | 9.7743% | 0.0030% |

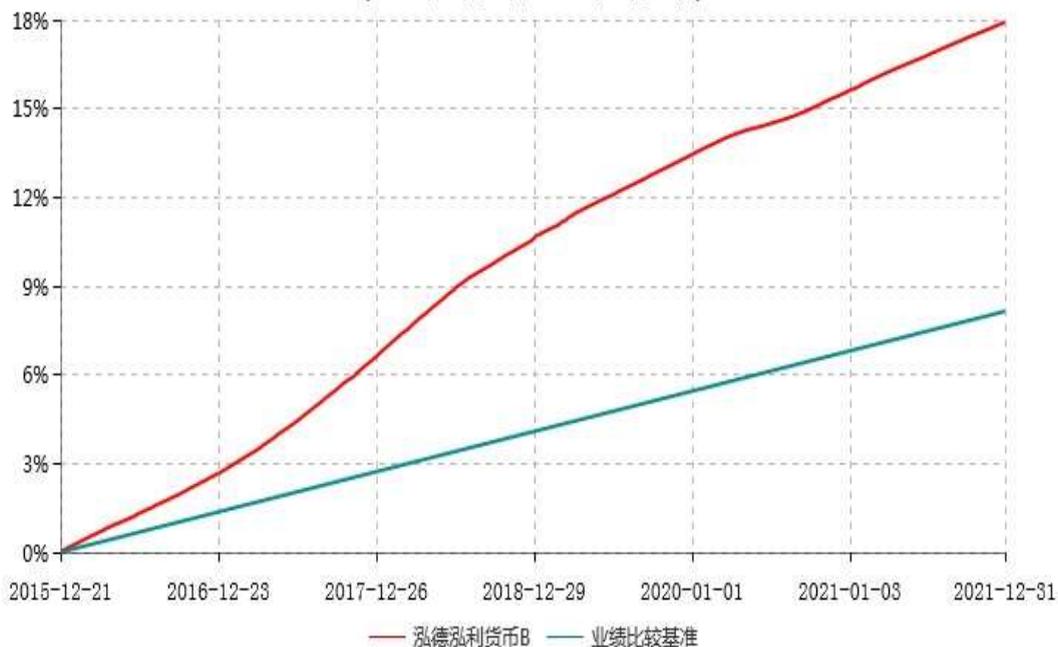
注：业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）

### 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

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-2021年12月31日)

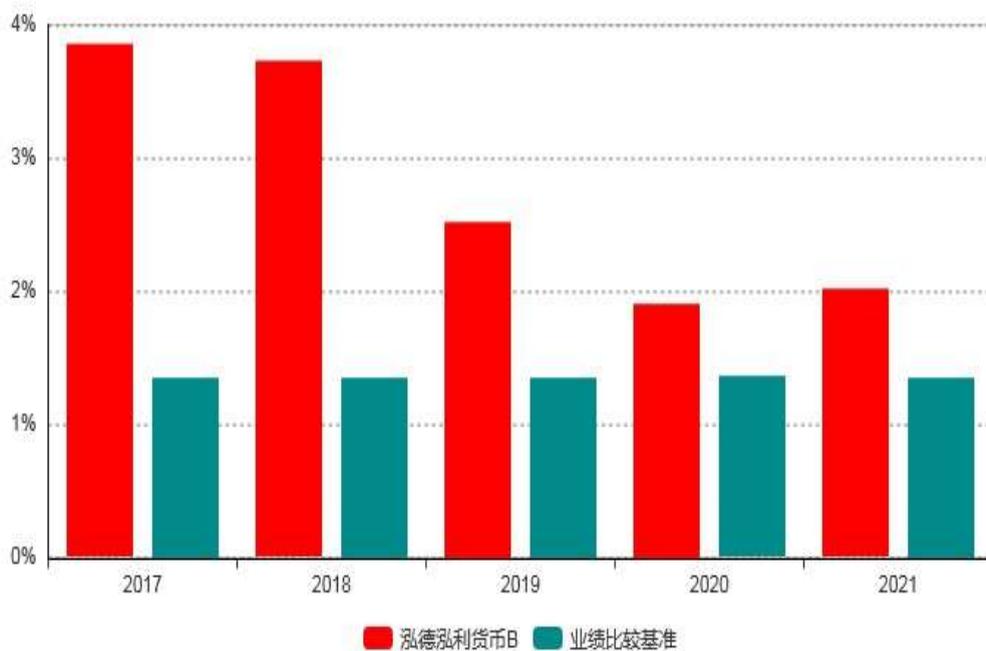
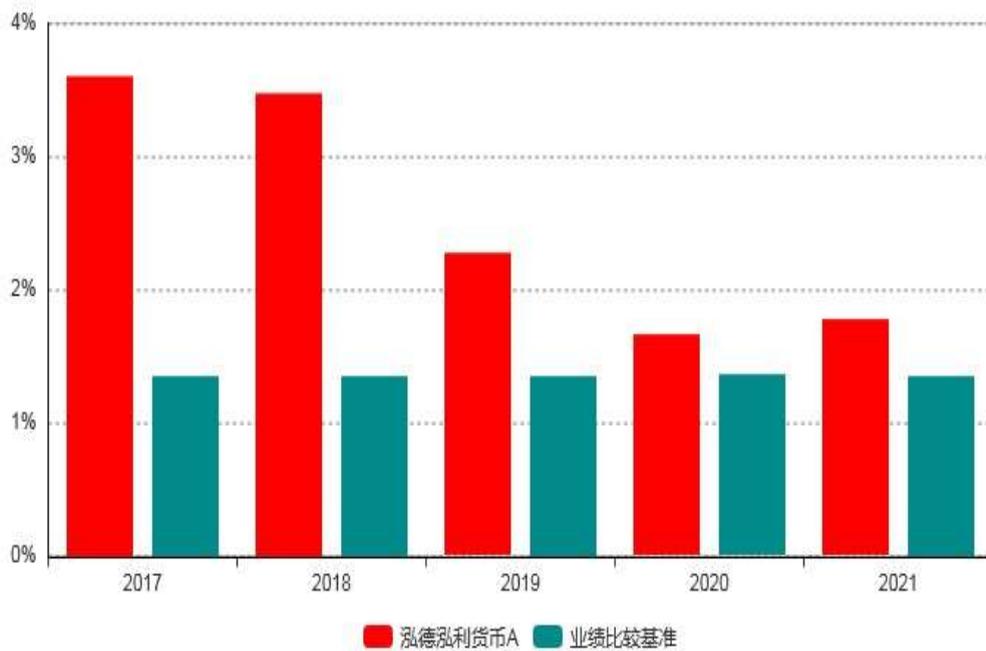


泓德泓利货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年12月21日-2021年12月31日)



注：根据基金合同的约定，本基金建仓期为 6 个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

### 3.2.3 过去五年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



### 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 |
|-------|--------------|---------------|----------|------------|----|
| 2021年 | 176,305.29   | -             | -518.14  | 175,787.15 | -  |
| 2020年 | 148,300.38   | -             | 85.70    | 148,386.08 | -  |
| 2019年 | 261,841.44   | -             | -397.26  | 261,444.18 | -  |
| 合计    | 586,447.11   | -             | -829.70  | 585,617.41 | -  |

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 |
|-------|---------------|---------------|------------|---------------|----|
| 2021年 | 6,929,161.96  | -             | -4,925.82  | 6,924,236.14  | -  |
| 2020年 | 6,427,630.25  | -             | -11,448.97 | 6,416,181.28  | -  |
| 2019年 | 8,951,326.14  | -             | -35,849.56 | 8,915,476.58  | -  |
| 合计    | 22,308,118.35 | -             | -52,224.35 | 22,255,894.00 | -  |

## § 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14300万元，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25.91%，阳光资产管理股份有限公司20.98%，泓德基业控股股份有限公司20.00%，珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）11.26%，南京民生租赁股份有限公司9.38%，江苏岛村实业发展有限公司9.38%，上海捷朔信息技术有限公司3.10%。

2021年，公司新发行5只公募基金产品，均为混合型基金。自成立起至2021年12月31日，公司累计发行了36只公募基金产品：其中混合型基金24只，具体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、泓德臻远回报混合、泓德三年封闭丰泽混合、泓德研究优选混合、泓德量化精选混合、泓德丰润三年持有期混合、泓德睿泽混合、泓德睿享一年持有期混合、泓德瑞兴三年持有期混合、

泓德卓远混合、泓德优质治理混合、泓德睿源三年持有期混合、泓德瑞嘉三年持有期混合、泓德睿诚混合、泓德慧享混合；股票型基金1只，具体为泓德战略转型股票；债券型基金9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、泓德裕丰中短债、泓德裕瑞三年定开债券；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（助理）期限 |            | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|--|-----------------|------------|--------|--|
|     |  | 任职日期            | 离任日期       |        |  |
| 毛静平 | 泓德裕康债券、泓德泓利货币、泓德添利货币、泓德裕丰中短债债券、泓德裕瑞三年定开债券、泓德裕和纯债债券基金经理 | 2018-09-12      | -          | 5年     | 硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验10年，曾任本公司固定收益投资部信用研究员，阳光资产管理股份有限公司信用研究员，毕马威华振会计师事务所审计师。 |
| 王璐  | 泓德泓利货币、泓德添利货币、泓德裕丰中短债债券基金经理                            | 2021-12-31      | -          | 4年     | 硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验9年，曾任本公司固定收益投资部专户投资经理，阳光资产管理股份有限公司信用管理部信用研究员。           |
| 李倩  | 基金经理   | 2015-12-21      | 2021-04-16 | 9年     | 硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验12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。 |
|--|--|--|--|--|-----------------|

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、本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。

本报告期内，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

2021年，宏观经济整体呈现前高后低的趋势。在全球疫情反复的背景下，国内由于防疫措施到位，工业生产体系完备，经济恢复领先全球。在稳增长压力较小的窗口期，政策端基于中长期视角做出了一系列改革，包括规范教培、反垄断、双碳双控、严控房

地产、管理隐债等等。从结构上来看，出口继续保持强劲，制造业稳步增长，内需中消费和基建较弱，房地产前高后低，下半年信用紧缩特别是地产信用的收紧使得实体融资需求大幅下行。

货币政策方面，面对PPI高企的压力，央行保持定力，注重预期引导，保持了稳健的货币政策，全年降准两次，整体来看市场资金面较为宽松。2021年，在经济基本面走弱和资金面宽松的背景下，长端利率债收益率呈下行趋势，其中，2021年末10年期国债收益率为2.7754%，较上年度下行36.75BP；2021年末10年期国开债收益率较上年度下行45.04BP至3.0834%。

报告期内组合投资以安全性、流动性为前提，主要配置性价比较高的存款、存单以及逆回购等资产提高组合收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德泓利货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.7647%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%；截至报告期末泓德泓利货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为2.0117%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%。

#### 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2022年，稳增长政策不断出台，随着宽信用的逐渐落地，宏观基本面有望持续改善；房地产政策虽然已转向，但销售投资等仍在探底过程中；海外方面，美国通胀加剧以及俄乌冲突不断升级等事件也将对市场造成一定冲击，短期经济数据将有所企稳，但基本面恢复节奏仍需观察。

#### 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。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 根据法律法规的要求，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) 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) 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) 按计划完成定期稽核工作，检查内容覆盖公司主要业务部门和业务环节，并对整改情况进行跟踪。

(5) 认真贯彻落实反洗钱各项法律法规, 切实履行金融机构的反洗钱法定义务, 将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程。

#### 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、投研总监、固定收益投资部、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债金融估值中心有限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《公开募集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, 2021年年度泓利货币A分配利润175,787.15元, 泓利货币B分配利润6,924,236.14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

本报告期, 托管人在泓德泓利货币市场证券投资基金的托管过程中, 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

本报告期, 泓德基金管理有限公司在泓德泓利货币市场证券投资基金投资运作、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: 175, 787. 15元, 向B级份额持有人分配利润: 6, 924, 236. 14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

本报告期, 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证券投资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(2022)第27590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   |
| 审计意见    | <p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了泓德泓利货币市场基金(以下简称“泓德泓利货币基金”)的财务报表, 包括2021年12月31日的资产负债表, 2021年度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。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附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券监督管理委员会(以下简称“中国证</p> |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | <p>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,公允反映了泓德泓利货币基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>  |
| 形成审计意见的基础       | <p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泓德泓利货币基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>  |
| 强调事项            | -   |
| 其他事项            | -   |
| 其他信息            | <p>泓德泓利货币基金的基金管理人泓德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括泓德泓利货币基金2021年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部</p>  |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | <p>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> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泓德泓利货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泓德泓利货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泓德泓利货币基金的财务报告过程。</p>   |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假</p> |

|           |  |     |
|-----------|--|-----|
|           | <p>设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对泓德泓利货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泓德泓利货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 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)   |     |
| 注册会计师的姓名  | 陈熹   | 俞伟敏 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼  |     |
| 审计报告日期    | 2022-03-29   |     |

## § 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：2021年12月31日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 427,307.00         | 18,416,478.97       |
| 结算备付金      |         | -                  | -                   |
| 存出保证金      |         | -                  | -                   |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 164,579,253.43             | 174,133,774.42              |
| 其中：股票投资         |            | -                          | -                           |
| 基金投资            |            | -                          | -                           |
| 债券投资            |            | 164,579,253.43             | 174,133,774.42              |
| 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    | 72,520,156.26              | -                           |
| 应收证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 356,779.70                 | 412,671.13                  |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | 600.00                     | 5,000.00                    |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 237,884,096.39             | 192,967,924.52              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2020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           |            | -                          | 499.25                      |
| 应付管理人报酬         |            | 44,688.39                  | 80,960.63                   |
| 应付托管费           |            | 14,300.26                  | 25,907.41                   |
| 应付销售服务费         |            | 3,393.76                   | 4,645.04                    |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 16,163.31                  | 23,771.81                   |
| 应交税费            |            | -                          | -                           |
| 应付利息            |            | -                          | -                           |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利润          |          | 13,522.43      | 18,966.39      |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 63,300.00      | 183,000.75     |
| 负债合计          |          | 155,368.15     | 337,751.28     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 237,728,728.24 | 192,630,173.24 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -              | -              |
| 所有者权益合计       |          | 237,728,728.24 | 192,630,173.24 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 237,884,096.39 | 192,967,924.52 |

注：报告截止日2021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237,728,728.24份，其中泓德泓利货币市场基金A类份额2,431,817.35份，泓德泓利货币市场基金B类份额235,296,910.89份。

## 7.2 利润表

会计主体：泓德泓利货币市场基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2021年01月01日至<br>2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至202<br>0年12月31日 |
|-------------------|----------|-----------------------------------|--|
| <b>一、收入</b>       |          | 8,551,460.59                      | 8,028,275.54                           |
| 1. 利息收入           |          | 8,548,882.79                      | 7,938,031.80                           |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.11 | 14,404.05                         | 301,692.00                             |
| 债券利息收入            |          | 6,228,064.16                      | 5,740,527.43                           |
| 资产支持证券利息收入        |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产收入        |          | 2,306,414.58                      | 1,895,812.37                           |
| 证券出借利息收入          |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入            |          | -                                 | -                                      |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 1,437.80                          | 90,243.74                              |

|                                 |          |              |              |
|---------------------------------|----------|--------------|--------------|
| 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 | 1,437.80     | 90,243.74    |
| 资产支持证券投资<br>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<br>失以“-”号填列）      | 7.4.7.16 | -            | -            |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）          |          | -            | -            |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）          | 7.4.7.17 | 1,140.00     | -            |
| <b>减：二、费用</b>                   |          | 1,451,437.30 | 1,463,708.18 |
| 1. 管理人报酬                        |          | 887,326.37   | 881,333.72   |
| 2. 托管费                          |          | 283,944.45   | 282,026.82   |
| 3. 销售服务费                        |          | 59,777.81    | 56,954.01    |
| 4. 交易费用                         | 7.4.7.18 | -            | -            |
| 5. 利息支出                         |          | -            | 17,485.62    |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |          | -            | 17,485.62    |
| 6. 税金及附加                        |          | -            | -            |
| 7. 其他费用                         | 7.4.7.19 | 220,388.67   | 225,908.01   |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>以“-”号填列）</b> |          | 7,100,023.29 | 6,564,567.36 |
| 减：所得税费用                         |          | -            | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |          | 7,100,023.29 | 6,564,567.36 |

### 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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                                    | 本期<br>2021年01月01日至2021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)                        | 192,630,173.24                     | -             | 192,630,173.24    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                  | 7,100,023.29  | 7,100,023.29      |
| 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)      | 45,098,555.00                      | -             | 45,098,555.00     |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,119,551,457.33                   | -             | 1,119,551,457.33  |
| 2. 基金赎回款                               | -1,074,452,902.33                  | -             | -1,074,452,902.33 |
| 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) | -                                  | -7,100,023.29 | -7,100,023.29     |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 237,728,728.24                     | -             | 237,728,728.24    |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020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)                        | 387,872,442.85                     | -             | 387,872,442.85    |
| 二、本期经营活动                               | -                                  | 6,564,567.36  | 6,564,567.36      |

|  |                   |               |                   |
|--|-------------------|---------------|-------------------|
| 产生的基金净值变动数(本期利润)                       |                   |               |                   |
| 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)      | -195,242,269.61   | -             | -195,242,269.61   |
| 其中:1.基金申购款                             | 1,194,286,133.75  | -             | 1,194,286,133.75  |
| 2.基金赎回款                                | -1,389,528,403.36 | -             | -1,389,528,403.36 |
| 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) | -                 | -6,564,567.36 | -6,564,567.36     |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 192,630,173.24    | -             | 192,630,173.24    |

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

王玲

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]第2650号《关于准予泓德泓利货币市场基金注册的批复》准予注册,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人民币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份基金份额，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。

根据《泓德泓利货币市场基金招募说明书》的规定，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。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《泓德泓利货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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。

根据2018年3月31日生效的《泓德泓利货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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2022年3月29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〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（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。

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2021年度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2021年12月31日的财务状况以及2021年度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。

##### 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和资产支持证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变动计入当期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。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证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。

债券投资和资产支持证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，以避免债券投资和资产支持证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负偏离度绝对值达到或超过0.25%时，或正偏离度达到或超过0.5%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和资产支持证券投资的公允价值：

(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

债券投资和资产支持证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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资或资产支持证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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益。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，每月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和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及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。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 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[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[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。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。

(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。

#### 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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 427,307.00         | 18,416,478.97       |
| 定期存款         | -                  | -                   |
| 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         | -                  | -                   |
| 合计           | 427,307.00         | 18,416,478.97       |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2021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 | 164,579,253.43      | 164,624,000.00 | 44,746.57  | 0.0188 |
|        | 合计    | 164,579,253.43      | 164,624,000.00 | 44,746.57  | 0.0188 |
| 资产支持证券 |       | -                   | -              | -          | -      |
| 合计     |       | 164,579,253.43      | 164,624,000.00 | 44,746.57  | 0.0188 |
| 项目     |       | 上年度末<br>2020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 | 174,133,774.42      | 174,297,500.00 | 163,725.58 | 0.0850 |

|  |        |                |                |            |        |
|--|--------|----------------|----------------|------------|--------|
|  | 合计     | 174,133,774.42 | 174,297,500.00 | 163,725.58 | 0.0850 |
|  | 资产支持证券 | -              | -              | -          | -      |
|  | 合计     | 174,133,774.42 | 174,297,500.00 | 163,725.58 | 0.0850 |

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。

#### 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<br>2021年12月31日  |           |
|-------|---------------------|-----------|
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                   | -         |
| 银行间市场 | 72,520,156.26       | -         |
| 合计    | 72,520,156.26       | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2020年12月31日 |           |
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                   | -         |
| 银行间市场 | -                   | -         |
| 合计    | -                   | -         |

##### 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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|----------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 70.82              | 844.63              |
| 应收定期存款利息 | -                  | -                   |
| 应收其他存款利息 | -                  | -                   |

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| 应收结算备付金利息  | -          | -          |
| 应收债券利息     | 351,780.82 | 411,826.50 |
| 应收资产支持证券利息 | -          | -          |
| 应收买入返售证券利息 | 4,928.06   | -          |
| 应收申购款利息    | -          | -          |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -          | -          |
| 应收出借证券利息   | -          | -          |
| 其他         | -          | -          |
| 合计         | 356,779.70 | 412,671.13 |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020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 | 16,163.31          | 23,771.81           |
| 合计          | 16,163.31          | 23,771.81           |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | 0.75                |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 预提费用        | 63,300.00          | 183,000.00          |
| 合计          | 63,300.00          | 183,000.75          |

#### 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<br>(泓德泓利货币A) | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |                |
|-----------------|-------------------------------|----------------|
|                 | 基金份额(份)                       | 账面金额           |
| 上年度末            | 6,944,607.40                  | 6,944,607.40   |
| 本期申购            | 41,435,392.29                 | 41,435,392.29  |
| 本期赎回(以“-”号填列)   | -45,948,182.34                | -45,948,182.34 |
| 本期末             | 2,431,817.35                  | 2,431,817.35   |

## 7.4.7.9.2 泓德泓利货币B

金额单位：人民币元

| 项目<br>(泓德泓利货币B) | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |                   |
|-----------------|-------------------------------|-------------------|
|                 | 基金份额(份)                       | 账面金额              |
| 上年度末            | 185,685,565.84                | 185,685,565.84    |
| 本期申购            | 1,078,116,065.04              | 1,078,116,065.04  |
| 本期赎回(以“-”号填列)   | -1,028,504,719.99             | -1,028,504,719.99 |
| 本期末             | 235,296,910.89                | 235,296,910.89    |

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<br>(泓德泓利货币A) | 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            | 175,787.15  | -     | 175,787.15  |
| 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         | -175,787.15 | -     | -175,787.15 |
| 本期末             | -           | -     | -           |

## 7.4.7.10.2 泓德泓利货币B

单位：人民币元

| 项目<br>(泓德泓利货币B) | 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            | 6,924,236.14  | -     | 6,924,236.14  |
| 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         | -6,924,236.14 | -     | -6,924,236.14 |
| 本期末             | -             | -     | -             |

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 14,404.05                         | 157,704.91                             |
| 定期存款利息收入  | -                                 | 143,541.96                             |
| 其他存款利息收入  | -                                 | -                                      |
| 结算备付金利息收入 | -                                 | 445.13                                 |
| 其他        | -                                 | -                                      |
| 合计        | 14,404.05                         | 301,692.00                             |

## 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

## 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月 |
|----|----------------------------|---------------------------------|
|----|----------------------------|---------------------------------|

|                         | 31日              | 31日              |
|-------------------------|------------------|------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,341,445,498.91 | 1,310,156,178.18 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,338,663,757.69 | 1,306,135,729.52 |
| 减：应收利息总额                | 2,780,303.42     | 3,930,204.92     |
| 买卖债券差价收入                | 1,437.80         | 90,243.74        |

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|--|
| 基金赎回费收入 | -                                 | -                                      |
| 其他      | 1,140.00                          | -                                      |
| 合计      | 1,140.00                          | -                                      |

#### 7.4.7.18 交易费用

本基金本报告期内及上年度可比期间无交易费用。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年<br>12月31日 |
|------|-----------------------------------|--|
| 审计费用 | 54,000.00                         | 54,000.00                              |

|         |            |            |
|---------|------------|------------|
| 信息披露费   | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | -          | -          |
| 汇划手续费   | 13,388.67  | 14,708.01  |
| 账户维护费   | 31,500.00  | 36,300.00  |
| 其他      | 1,500.00   | 900.00     |
| 合计      | 220,388.67 | 225,908.01 |

#### 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，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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               |
| 阳光资产管理股份有限公司           | 基金管理人股东               |
| 泓德基业控股股份有限公司           | 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 887,326.37                    | 881,333.72                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,427.50                      | 7,462.72                           |

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%的年费率每日计提，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×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<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 283,944.45                    | 282,026.82                         |

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%的年费率每日计提，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×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<br>2021年01月01日至2021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           | 21,380.62                          | 34,481.15 | 55,861.77 |
| 交通银行           | 1,176.49                           | 0.00      | 1,176.49  |
| 合计             | 22,557.11                          | 34,481.15 | 57,038.26 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020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           | 11,996.35                          | 33,985.59 | 45,981.94 |
| 交通银行           | 3,526.92                           | 0.00      | 3,526.92  |

|    |           |           |           |
|----|-----------|-----------|-----------|
| 合计 | 15,523.27 | 33,985.59 | 49,508.86 |
|----|-----------|-----------|-----------|

注：支付基金销售机构的销售服务费A类份额按前一日基金资产净值0.25%的年费率每日计提，B类份额按前一日基金资产净值0.01%的年费率每日计提，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类份额日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

B类份额日销售服务费=前一日基金资产净值×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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与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

泓德泓利货币A

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2021年01月01日至<br>2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至<br>2020年12月31日 |
|---------------------|-----------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额         | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期间申购/买入总份额        | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期间因拆分变动份额         | 0.00                              | 0.00                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额         | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00%                             | 0.00%                                  |

泓德泓利货币B

份额单位：份

| 项目             | 本期<br>2021年01月01日至<br>2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至<br>2020年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额    | 38,000,000.00                     | 0.00                                   |
| 报告期间申购/买入总份额   | 381,397,348.39                    | 38,000,000.00                          |
| 报告期间因拆分变动份额    | 0.00                              | 0.00                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 368,775,713.01                    | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额    | 50,621,635.38                     | 38,000,000.00                          |

|                     |        |        |
|---------------------|--------|--------|
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 21.29% | 19.73% |
|---------------------|--------|--------|

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 期间赎回/卖出总份额含基金转换（出）份额。

3. 基金管理人在本年度及上年度可比期间申购/赎回本基金的交易委托直销柜台办理，本基金申购/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末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020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  | 427,307.00                    | 14,404.05 | 18,416,478.97                      | 157,704.91 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 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<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润<br>分配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 176,305.29       | -                 | -518.14      | 175,787.15   | -  |

泓德泓利货币B

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润<br>分配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 6,929,161.96     | -                 | -4,925.82    | 6,924,236.14 | -  |

#### 7.4.12 期末（2021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。

#### 7.4.12.2 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。

#### 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

本基金本报告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

本基金本报告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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，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，投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%，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。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净值产的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。

#### 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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 15,002,889.77      | -                   |
| 合计     | 15,002,889.77      | -                   |

注：于2021年12月31日，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。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.3 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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 149,576,363.66     | 159,131,452.79      |
| 合计     | 149,576,363.66     | 159,131,452.79      |

#### 7.4.13.2.4 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 | 上年度末 |
|--------|-----|------|
|--------|-----|------|

|       | 2021年12月31日 | 2020年12月31日   |
|-------|-------------|---------------|
| AAA   | -           | -             |
| AAA以下 | -           | -             |
| 未评级   | -           | 15,002,321.63 |
| 合计    | -           | 15,002,321.63 |

注：于2020年12月31日，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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单。

#### 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。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、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，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%。

于本报告期期末，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

#### 7.4.13.3.1 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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，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，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过240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；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总

份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，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60天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%。于本报告期期末，本基金前10名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为99.50%，本基金投资组合的平均剩余期限为29天，平均剩余存续期为29天。本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例为45.41%。

本基金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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%。于本报告期期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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<br>2021年1<br>2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                    | 427,307.00     | -      | -    | -    | -          | 427,307.00     |
| 交易性金融资产                 | 164,579,253.43 | -      | -    | -    | -          | 164,579,253.43 |
| 买入返售金融资产                | 72,520,156.26  | -      | -    | -    | -          | 72,520,156.26  |
| 应收利息                    | -              | -      | -    | -    | 356,779.70 | 356,779.70     |
| 应收申购款                   | -              | -      | -    | -    | 600.00     | 600.00         |
| 资产总计                    | 237,526,716.69 | -      | -    | -    | 357,379.70 | 237,884,096.39 |
| 负债                      |                |        |      |      |            |                |
| 应付管理人报酬                 | -              | -      | -    | -    | 44,688.39  | 44,688.39      |
| 应付托管费                   | -              | -      | -    | -    | 14,300.26  | 14,300.26      |
| 应付销售服务费                 | -              | -      | -    | -    | 3,393.76   | 3,393.76       |
| 应付交易费用                  | -              | -      | -    | -    | 16,163.31  | 16,163.31      |
| 应付利润                    | -              | -      | -    | -    | 13,522.43  | 13,522.43      |
| 其他负债                    | -              | -      | -    | -    | 63,300.00  | 63,300.00      |
| 负债总计                    | -              | -      | -    | -    | 155,368.15 | 155,368.15     |
| 利率敏感度缺口                 | 237,526,716.69 | -      | -    | -    | 202,011.55 | 237,728,728.24 |
| 上年度末<br>2020年1<br>2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                    | 18,416,478.97  | -      | -    | -    | -          | 18,416,478.97  |

|         |                |   |   |   |            |                |
|---------|----------------|---|---|---|------------|----------------|
| 交易性金融资产 | 174,133,774.42 | - | - | - | -          | 174,133,774.42 |
| 应收利息    | -              | - | - | - | 412,671.13 | 412,671.13     |
| 应收申购款   | -              | - | - | - | 5,000.00   | 5,000.00       |
| 资产总计    | 192,550,253.39 | - | - | - | 417,671.13 | 192,967,924.52 |
| 负债      |                |   |   |   |            |                |
| 应付赎回款   | -              | - | - | - | 499.25     | 499.25         |
| 应付管理人报酬 | -              | - | - | - | 80,960.63  | 80,960.63      |
| 应付托管费   | -              | - | - | - | 25,907.41  | 25,907.41      |
| 应付销售服务费 | -              | - | - | - | 4,645.04   | 4,645.04       |
| 应付交易费用  | -              | - | - | - | 23,771.81  | 23,771.81      |
| 应付利润    | -              | - | - | - | 18,966.39  | 18,966.39      |
| 其他负债    | -              | - | - | - | 183,000.75 | 183,000.75     |
| 负债总计    | -              | - | - | - | 337,751.28 | 337,751.28     |
| 利率敏感度缺口 | 192,550,253.39 | - | - | - | 79,919.85  | 192,630,173.24 |

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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2021年12月31日              | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|    | 市场利率下降25个基点        | 45,703.84                       | 81,891.85           |
|    | 市场利率上升25个基点        | -45,671.26                      | -81,799.05          |

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，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2021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164,579,253.43元，无属于第一或第三层次的余额(2020年12月31日：第二层次174,133,774.42元，无第一或第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间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2021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(2020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) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的

评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，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            | 164,579,253.43 | 69.18         |
|    | 其中：债券             | 164,579,253.43 | 69.18         |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 72,520,156.26  | 30.49         |
|    | 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      | 427,307.00     | 0.18          |
| 4  | 其他各项资产            | 357,379.70     | 0.15          |
| 5  | 合计                | 237,884,096.39 | 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 | 0.00          |               |
|    | 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**

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    | 29 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 58 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 15 |

**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                | 64.30               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30天(含)—60天           | 23.05               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60天(含)—90天           | 12.56               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90天(含)—120天          | -                   | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | -                   | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                   | 99.92               | -                   |

**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<br>(%) |
|----|--------------------|----------------|------------------|
| 1  | 国家债券               | -              | -                |
| 2  | 央行票据               | -              | -                |
| 3  | 金融债券               | 15,002,889.77  | 6.31             |
|    | 其中：政策性金融债          | 15,002,889.77  | 6.31             |
| 4  | 企业债券               | -              | -                |
| 5  | 企业短期融资券            | -              | -                |
| 6  | 中期票据               | -              | -                |
| 7  | 同业存单               | 149,576,363.66 | 62.92            |
| 8  | 其他                 | -              | -                |
| 9  | 合计                 | 164,579,253.43 | 69.23            |
| 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  | 112108006 | 21中信银行CD<br>006 | 300,000 | 29,950,537.4<br>4 | 12.60        |
| 2  | 112117055 | 21光大银行CD<br>055 | 300,000 | 29,857,828.2<br>3 | 12.56        |
| 3  | 112109003 | 21浦发银行CD<br>003 | 200,000 | 19,991,752.9<br>4 | 8.41         |
| 4  | 112104025 | 21中国银行CD<br>025 | 200,000 | 19,972,528.6<br>0 | 8.40         |
| 5  | 112110097 | 21兴业银行CD<br>097 | 200,000 | 19,921,924.5<br>7 | 8.38         |

|   |           |                 |         |                   |      |
|---|-----------|-----------------|---------|-------------------|------|
| 6 | 112111075 | 21平安银行CD<br>075 | 200,000 | 19,920,958.5<br>6 | 8.38 |
| 7 | 210201    | 21国开01          | 100,000 | 10,001,268.5<br>4 | 4.21 |
| 8 | 112109079 | 21浦发银行CD<br>079 | 100,000 | 9,960,833.32      | 4.19 |
| 9 | 210401    | 21农发01          | 50,000  | 5,001,621.23      | 2.10 |

注：本基金本报告期末仅持有九只债券。

### 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 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                  | 0.0931%  |
| 报告期内偏离度的最低值                  | -0.0497% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值       | 0.0129%  |

#### 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 期末按摊余成本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 报告期内本基金投资的前十名证券在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚情形如下：

2021年03月17日，21中信银行CD006（证券代码：112108006）发行人中信银行股份有限公司因客户信息保护体制机制不健全等被中国银行保险监督管理委员会罚款450万元。

2021年02月05日，21中信银行CD006（证券代码：112108006）发行人中信银行股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务等被中国人民银行罚款2890万元。

2021年10月09日，21浦发银行CD003（证券代码：112109003）、21浦发银行CD079（证券代码：112109079）发行人上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心因2018年5月至2019年2月，该中心信息安全和员工行为管理严重违反审慎经营规则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50万元。

2021年07月13日，21浦发银行CD003（证券代码：112109003）、21浦发银行CD079（证券代码：112109079）发行人上海浦东发展银行股份有限公司因监管发现的问题屡查屡犯、配合现场检查不力等被中国银行保险监督管理委员会罚款6920万元。

2021年05月07日，21浦发银行CD003（证券代码：112109003）、21浦发银行CD079（证券代码：112109079）发行人上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心因信用卡资金流向管控严重违反审慎经营规则被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款人民币40万元。

2021年04月23日，21浦发银行CD003（证券代码：112109003）、21浦发银行CD079（证券代码：112109079）发行人上海浦东发展银行股份有限公司因2016年5月至2019年1月未按规定开展代销业务被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款共计760万元。

2021年05月17日，21中国银行CD025（证券代码：112104025）发行人中国银行股份有限公司因向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款、违规向关系人发放信用贷款等被中国银行保险监督管理委员会罚没8761.355万元。

2021年08月13日，21兴业银行CD097（证券代码：112110097）发行人兴业银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定被中国人民银行罚款5万元。

2021年05月28日，21平安银行CD075（证券代码：112111075）发行人平安银行股份有限公司因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款、固定资产授信严重不审慎、贷款用途审查监控不到位、贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资等被中国银行保险监督管理委员会云南监管局罚款人民币210万元。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。

### 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    | 356,779.70 |
| 4  | 应收申购款   | 600.00     |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 5 | 其他应收款 | -          |
| 6 | 待摊费用  | -          |
| 7 | 其他    | -          |
| 8 | 合计    | 357,379.70 |

#### 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存在尾差。

### § 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<br>级别        | 持有<br>人户<br>数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>份额<br>比例 | 持有份额         | 占总份<br>额比例 |
| 泓德<br>泓利<br>货币A | 395                  | 6,156.50          | 1,138,597.10   | 46.8<br>2%     | 1,293,220.25 | 53.18%     |
| 泓德<br>泓利<br>货币B | 8                    | 29,412,113.<br>86 | 235,296,910.89 | 100.0<br>0%    | 0.00         | 0.00%      |
| 合计              | 403                  | 589,897.59        | 236,435,507.99 | 99.4<br>6%     | 1,293,220.25 | 0.54%      |

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)       | 占总份额比例   |
|----|-------|---------------|----------|
| 1  | 基金类机构 | 51,209,929.14 | 21.5697% |
| 2  | 基金类机构 | 50,621,635.38 | 21.3219% |
| 3  | 基金类机构 | 44,617,320.04 | 18.7929% |
| 4  | 保险类机构 | 29,977,339.30 | 12.6265% |
| 5  | 保险类机构 | 28,083,442.50 | 11.8288% |

|    |       |               |         |
|----|-------|---------------|---------|
| 6  | 基金类机构 | 13,000,000.00 | 5.4756% |
| 7  | 基金类机构 | 9,000,000.00  | 3.7908% |
| 8  | 基金类机构 | 8,478,031.70  | 3.571%  |
| 9  | 基金类机构 | 1,125,294.44  | 0.474%  |
| 10 | 个人    | 105,678.06    | 0.0445% |

### 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<br>(份) | 占基金总份额比<br>例 |
|------------------|---------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 泓德泓利货币A | 4,303.52      | 0.1772%      |
|                  | 泓德泓利货币B | 0.00          | 0.0000%      |
|                  | 合计      | 4,303.52      | 0.0018%      |

注：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<br>间（万份） |
|--|---------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式<br>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<br>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

|                                | 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<br>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                   | 6,944,607.40 | 185,685,565.84 |

|               |               |                  |
|---------------|---------------|------------------|
| 本报告期基金总申购份额   | 41,435,392.29 | 1,078,116,065.04 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 45,948,182.34 | 1,028,504,719.99 |
| 本报告期期末基金份额总额  | 2,431,817.35  | 235,296,910.89   |

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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 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54,000.00元，已连续为本基金提供审计服务7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、证券交易所施以重大处罚或公开谴责，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 | 股票交易 |      | 应支付该券商的佣金 |      | 备注 |
|------|----|------|------|-----------|------|----|
|      |    | 成交金额 | 占当期股 | 佣金        | 占当期佣 |    |
|      |    |      |      |           |      |    |

|        | 单元数量 |   | 票成交总额的比 |   | 金总量的比例 |   |
|--------|------|---|---------|---|--------|---|
| 国都证券   | 1    | - | -       | - | -      | - |
| 天风证券   | 1    | - | -       | - | -      | - |
| 中银国际证券 | 2    | - | -       | - | -      | - |
| 中信证券   | 3    | - | -       | - | -      | - |

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 经营行为规范，内控制度健全，信誉良好。

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(3) 研究实力较强，能及时为本公司提供高质量的研究服务。

(4) 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) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元：无

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无

### 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 |
| 国都证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 天风证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中银国际证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

### 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。

## 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  | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国泰君安证券股份有限公司费率优惠活动并调整最低申购及定投金额起点的公告    | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-13 |
| 2  | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为销售机构及参与其费率优惠的公告             | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-16 |
| 3  | 泓德基金管理有限公司关于泓德泓利货币市场基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告              | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-06 |
| 4  | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券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、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-20 |
| 5  | 泓德基金管理有限公司关于北京植信基金销售有限公司开通定投及转换业务并调整申购金额起点的公告              | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-11 |
| 6  | 泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与北京汇成基金销售有限公司基金转换费率优惠的公告                  | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-01 |
| 7  | 泓德基金管理有限公司关于泓德泓利货币市场基金解聘基金经理的公告                            | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-16 |
| 8  | 泓德基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告                            | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-22 |

|    |   |                         |            |
|----|---|-------------------------|------------|
| 9  | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京度小满基金销售有限公司为销售机构的公告 | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-08-10 |
| 10 | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告    | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-10-19 |
| 11 | 泓德基金管理有限公司关于泓德泓利货币市场基金增聘基金经理的公告           | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-31 |

## § 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  | 1              | 2021/01/01-2021/01/04  | 47,314,509.54 | 13,484,913.05  | 47,799,422.59  | 13,000,000.00 | 5.48%  |
|   | 2              | 2021/01/05-2021/09/26  | 0.00          | 157,087,675.34 | 157,087,675.34 | 0.00          | 0.00%  |
|   | 3              | 2021/01/06-2021/02/07, 2021/03/09-2021/03/24, 2021/04/06-2021/05/11, 2021/09/03-2021/12/31 | 38,000,000.00 | 381,356,458.85 | 368,734,823.47 | 50,621,635.38 | 21.32% |
|   | 4              | 2021/12/21-2021/12/31  | 19,767,269.17 | 32,942,659.97  | 1,500,000.00   | 51,209,929.14 | 21.57% |
|   | 5              | 2021/12/21-2021/12/28  | 27,806,586.50 | 26,460,733.54  | 9,650,000.00   | 44,617,320.04 | 18.79% |
| 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

### 13.3 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  
二〇二二年三月三十日