

泓德泓利货币市场基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 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:2023 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至2023年6月30日止。

1.2 目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 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 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 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 | 14 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 18 |
| 6.4 报表附注 | 21 |
| §7 投资组合报告 | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 41 |
| 7.2 债券回购融资情况 | 42 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限 | 42 |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 43 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 44 |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 | 44 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 | 45 |
| 7.9 投资组合报告附注 | 45 |
| §8 基金份额持有人信息 | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 46 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 | 46 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 47 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 47 |

| | |
|------------------------------------|----|
| §9 开放式基金份额变动 | 47 |
| §10 重大事件揭示 | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 48 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 49 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 49 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 49 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 | 50 |
| 10.9 其他重大事件 | 50 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 52 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 52 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 52 |
| §12 备查文件目录 | 52 |
| 12.1 备查文件目录 | 52 |
| 12.2 存放地点 | 53 |
| 12.3 查阅方式 | 53 |

§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 | 102,146,360.39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 | 泓德泓利货币C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002184 | 002185 | 017542 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,165,370.22份 | 99,965,146.35份 | 15,843.82份 |

注：本基金于2022年12月2日新增C类份额。

2.2 基金产品说明

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

| | |
|--|---------------------------------------|
| | 低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。 |
|--|---------------------------------------|

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|---------------------------|-----------------------|
| 名称 | | 泓德基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 李晓春 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 010-59850177 | 95559 |
| | 电子邮箱 | lixiaochun@hongdefund.com | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 4009-100-888 | 95559 |
| 传真 | | 010-59322130 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室 | 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》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.hongdefund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 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 |
|--------|------------|------------------|
| 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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日) | | |
|---------------|----------------------------------|---------------|-----------|
| | 泓德泓利货币A | 泓德泓利货币B | 泓德泓利货币C |
| 本期已实现收益 | 22,617.18 | 629,508.12 | 149.59 |
| 本期利润 | 22,617.18 | 629,508.12 | 149.59 |
| 本期净值收益率 | 0.6279% | 0.7482% | 0.6297% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2023年06月30日) | | |
| 期末基金资产净值 | 2,165,370.22 | 99,965,146.35 | 15,843.82 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2023年06月30日) | | |
| 累计净值收益率 | 18.4036% | 20.5697% | 0.7242% |

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 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.1091% | 0.0004% | 0.1110% | 0.0000% | -0.0019% | 0.0004% |
| 过去三个月 | 0.3135% | 0.0004% | 0.3366% | 0.0000% | -0.0231% | 0.0004% |
| 过去六个月 | 0.6279% | 0.0005% | 0.6695% | 0.0000% | -0.0416% | 0.0005% |

| | | | | | | |
|------------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|
| 过去一年 | 1.1500% | 0.0005% | 1.3500% | 0.0000% | -0.2000% | 0.0005% |
| 过去三年 | 4.5556% | 0.0011% | 4.0500% | 0.0000% | 0.5056% | 0.0011% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.4036% | 0.0031% | 10.1675% | 0.0000% | 8.2361% | 0.0031% |

泓德泓利货币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 |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.1289% | 0.0004% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0179% | 0.0004% |
| 过去三个月 | 0.3741% | 0.0004% | 0.3366% | 0.0000% | 0.0375% | 0.0004% |
| 过去六个月 | 0.7482% | 0.0005% | 0.6695% | 0.0000% | 0.0787% | 0.0005% |
| 过去一年 | 1.3939% | 0.0005% | 1.3500% | 0.0000% | 0.0439% | 0.0005% |
| 过去三年 | 5.3140% | 0.0011% | 4.0500% | 0.0000% | 1.2640% | 0.0011% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.5697% | 0.0031% | 10.1675% | 0.0000% | 10.4022% | 0.0031% |

泓德泓利货币C

| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较 基准收益 率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.1095% | 0.0004% | 0.1110% | 0.0000% | -0.0015% | 0.0004% |
| 过去三个月 | 0.3154% | 0.0004% | 0.3366% | 0.0000% | -0.0212% | 0.0004% |
| 过去六个月 | 0.6297% | 0.0005% | 0.6695% | 0.0000% | -0.0398% | 0.0005% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.7242% | 0.0005% | 0.7693% | 0.0000% | -0.0451% | 0.0005% |

注：业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）

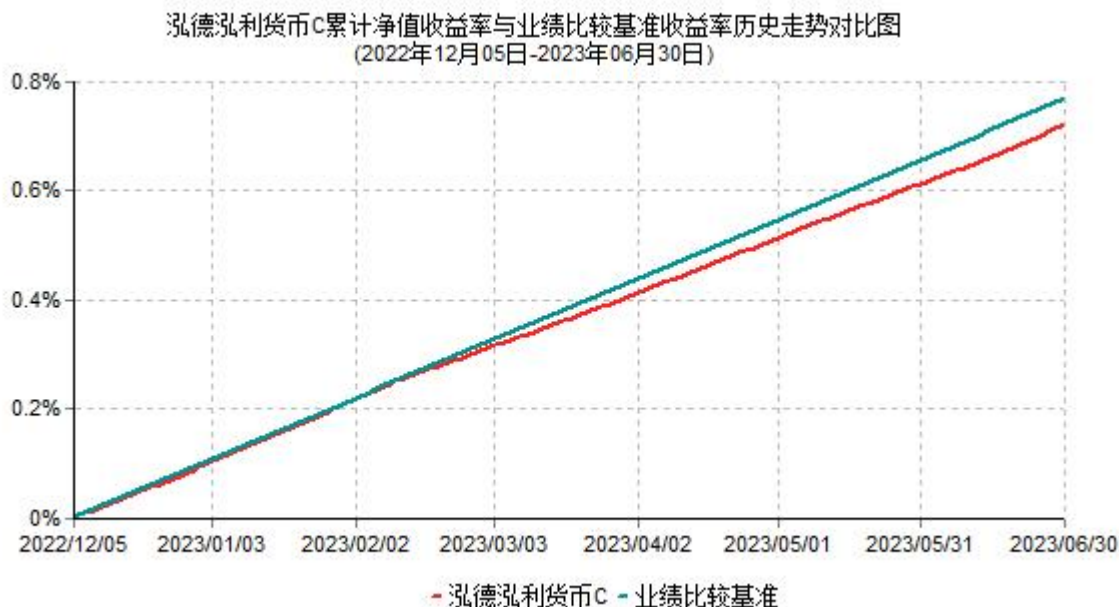
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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-2023年06月30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-2023年06月30日)





注：1、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。

2、本基金于2022年12月2日增设C类份额，份额登记日从2022年12月5日起，以上C类份额走势图从2022年12月5日开始。

§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号文批准设立的由专业人士发起设立的公募基金基金管理公司。公司注册资本为人民币1.43亿元，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（西藏）企业管理有限公司20.00%，珠海市基业长青投资中心（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%。

公司始终坚持“持有人利益优先”原则，聚焦主动投资管理，坚持长期价值投资，深度研究创造价值，追求长期、稳定、持续的一致性获利，致力于成为能持续为客户创造价值的、受人尊重的专业化资产管理公司。公司已覆盖从公募到专户、从股票投资到固定收益投资、从低风险到高风险等不同产品类型，公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等基金品种。

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 | 本基金的基金经理 | 2018-09-12 | - | 6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 | 本基金的基金经理 | 2021-12-31 | - | 5年 | 硕士研究生，具有基金从业资格，资管行业从业经验11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。 |

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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现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

2023年上半年，经历了后疫情时代，宏观经济的修复，似乎比预期的要更为艰难，年初开始，各项稳增长政策同步发力，但就业和疫后的疤痕效应在持续影响消费的恢复斜率，地方财政收入的约束以及隐性债务化解的问题使得地方加杠杆能力在减弱，房地产政策虽然持续推出，但仍在反复触底缓慢修复的过程中，外围经济对出口的影响在逐渐凸显。

从债市表现来看，一季度受信贷投放等因素影响，资金中枢小幅上移，流动性分层加剧，债市收益率上行，短端上行幅度较大，进入二季度，随着经济修复的斜率放缓，货币政策边际宽松，直至6月中旬央行降息，期间经历了市场的陡峭化下行，以及降息后止盈情绪带来的小幅回调。整个上半年来看，10年国债下行20BP至2.6351%，10年国开下行22BP至2.7727%。1年国债下行22BP至1.8723%，1年国开下行14BP至2.0949%。

由于信贷环境的支持，整体信用风险有所缓释，但企业信用风险状况仍呈现分化状态，典型的是民企地产的风险仍在逐渐累积，以及部分区域城投的信用风险的暴露。从市场来看，相比较利率债的跌宕起伏，信用债在去年四季度流动性冲击后，上半年利差重新修复，短端中低等级品种表现最优，整体信用利差大幅收窄。

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0.6279%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；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0.7482%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；截至报告期末泓德泓利货币C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0.6297%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，制约宏观基本面的两大因素：消费的持续低迷和地产行业的修复难度；随着政治局会议将把稳就业提高到战略高度通盘考虑，对房地产行业供需状况改变的定调，宏观基本面有望持续改善，但需要注意的是，海外经济回落导致出口依旧承压，同时，地产相关支持政策将逐渐发力，销售有望企稳回升，但投资恢复需要较长过程，地方政府财政收入乏力，进一步加杠杆空间有限。整体来看，经济修复仍有一定难度，可以确定的是，货币政策配合力度将进一步加大，总量宽松和结构政策都会持续支持实体经济。无论是政策还是基本面对于债券市场来说都相对友好，资金面将持续宽松，信用方面，随着基本面的好转，信用风险有所缓释，但仍须警惕风险事件，不适合过度下沉，可适当选择优质龙头企业进行配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值小组,估值小组负责指导和监督整个估值流程。估值小组成员均具有多年证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备投资、研究、基金估值运作、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小组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。

4.7 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，2023年上半年度泓德泓利货币A分配利润22,617.18元,泓德泓利货币B分配利润629,508.12元，泓德泓利货币C分配利润149.59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，托管人在泓德泓利货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，泓德基金管理有限公司在泓德泓利货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润：22,617.18元，向B级份额持有人分配利润：629,508.12元。向C级份额持有人分配利润：149.59元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，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基金的中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德泓利货币市场基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,417,281.97 | 237,058.57 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 60,203,644.36 | 114,723,816.17 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 60,203,644.36 | 114,723,816.17 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 40,652,150.64 | 26,005,052.80 |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 1,003.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 102,273,076.97 | 140,966,930.54 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 15,081.92 | 29,885.40 |
| 应付托管费 | | 4,826.20 | 9,563.31 |
| 应付销售服务费 | | 1,035.05 | 2,073.39 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | 5,520.86 | 7,048.33 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 100,252.55 | 66,080.87 |
| 负债合计 | | 126,716.58 | 114,651.30 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 102,146,360.39 | 140,852,279.24 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | - | - |
| 净资产合计 | | 102,146,360.39 | 140,852,279.24 |
| 负债和净资产总计 | | 102,273,076.97 | 140,966,930.54 |

注：报告截止日2023年06月30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102,146,360.39份，其中泓德泓利货币市场基金A类份额2,165,370.22份，泓德泓利货币市场基金B类份额99,965,146.35份，泓德泓利货币市场基金C类份额15,843.82份。

6.2 利润表

会计主体：泓德泓利货币市场基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023年01月01日至 2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日 |
|-----------|---------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | 908,463.39 | 2,284,980.57 |
| 1.利息收入 | | 199,230.16 | 508,999.26 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 2,950.43 | 3,301.51 |
| 债券利息收入 | | - | - |

| | | | |
|------------------|----------|------------|--------------|
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 196,279.73 | 505,697.75 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 709,233.23 | 1,775,981.31 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 709,233.23 | 1,775,981.31 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 以摊余成本计量的 | | - | - |
| 金融资产终止确认 | | - | - |
| 产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失 | 6.4.7.14 | - | - |
| 以“-”号填列） | | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-” | | - | - |
| 号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-” | 6.4.7.15 | - | - |
| 号填列） | | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 256,188.50 | 475,184.44 |
| 1. 管理人报酬 | | 107,590.78 | 268,059.07 |
| 2. 托管费 | | 34,429.05 | 85,778.91 |
| 3. 销售服务费 | | 8,647.54 | 16,086.65 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |

| | | | |
|---------------------|-------------|------------|--------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6. 4. 7. 16 | 105,521.13 | 105,259.81 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 652,274.89 | 1,809,796.13 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 652,274.89 | 1,809,796.13 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 652,274.89 | 1,809,796.13 |

6.3 净资产（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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | | |
|-----------------|-------------------------------|--------|-------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 140,852,279.24 | - | - | 140,852,279.24 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 140,852,279.24 | - | - | 140,852,279.24 |

| | | | | |
|--|------------------------------------|--------|-------------|-----------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -38,705,918.85 | - | - | -38,705,918.85 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 652,274.89 | 652,274.89 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -38,705,918.85 | - | - | -38,705,918.85 |
| 其中：1.基金申购款 | 121,990,901.05 | - | - | 121,990,901.05 |
| 2.基金赎回款 | -160,696,819.90 | - | - | -160,696,819.90 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | -652,274.89 | -652,274.89 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 102,146,360.39 | - | - | 102,146,360.39 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 237,728,728.24 | - | - | 237,728,728.24 |

| | | | | |
|--|-----------------|---|---------------|-----------------|
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 237,728,728.24 | - | - | 237,728,728.24 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -70,525,896.42 | - | - | -70,525,896.42 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 1,809,796.13 | 1,809,796.13 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -70,525,896.42 | - | - | -70,525,896.42 |
| 其中：1.基金申购款 | 75,157,008.62 | - | - | 75,157,008.62 |
| 2.基金赎回款 | -145,682,905.04 | - | - | -145,682,905.04 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | -1,809,796.13 | -1,809,796.13 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 167,202,831.82 | - | - | 167,202,831.82 |

| | | | | |
|----------|--|--|--|--|
| 资产（基金净值） | | | | |
|----------|--|--|--|--|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王德晓

李娇

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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

本基金分设三类基金份额：A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额。三类基金份额分设不同的基金代码并分别公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。本基金A类基金份额和B类基金份额之间可自动升降级，C类基金份额不开通自动升级、自动降级业务。

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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年1月1日至2023年6月30日止期间的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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款 | 1,417,281.97 |
| 等于：本金 | 1,417,135.63 |
| 加：应计利息 | 146.34 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |

| | |
|----|--------------|
| 合计 | 1,417,281.97 |
|----|--------------|

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2023年06月30日 | | | |
|----|--------|--------------------|---------------|-----------|--------|
| | | 按实际利率计算的账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度(%) |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 60,203,644.36 | 60,219,657.53 | 16,013.17 | 0.0157 |
| | 合计 | 60,203,644.36 | 60,219,657.53 | 16,013.17 | 0.0157 |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| | 合计 | 60,203,644.36 | 60,219,657.53 | 16,013.17 | 0.0157 |

注：1、偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；

2、偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 | |
|-------|--------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 40,652,150.64 | - |
| 合计 | 40,652,150.64 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 9,129.69 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 9,129.69 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 91,122.86 |
| 合计 | 100,252.55 |

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 泓德泓利货币A

金额单位：人民币元

| 项目 (泓德泓利货币A) | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|-----------------|-------------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 4,279,025.23 | 4,279,025.23 |
| 本期申购 | 337,398.55 | 337,398.55 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,451,053.56 | -2,451,053.56 |
| 本期末 | 2,165,370.22 | 2,165,370.22 |

6.4.7.7.2 泓德泓利货币B

金额单位：人民币元

| 项目 (泓德泓利货币B) | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|-----------------|-------------------------------|------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |

| | | |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 136,533,398.35 | 136,533,398.35 |
| 本期申购 | 121,653,351.93 | 121,653,351.93 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -158,221,603.93 | -158,221,603.93 |
| 本期末 | 99,965,146.35 | 99,965,146.35 |

6.4.7.7.3 泓德泓利货币C

金额单位：人民币元

| 项目 (泓德泓利货币C) | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|-----------------|-------------------------------|------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 39,855.66 | 39,855.66 |
| 本期申购 | 150.57 | 150.57 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -24,162.41 | -24,162.41 |
| 本期末 | 15,843.82 | 15,843.82 |

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。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 泓德泓利货币A

单位：人民币元

| 项目 (泓德泓利货币A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------|------------|-------|------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 22,617.18 | - | 22,617.18 |
| 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 | -22,617.18 | - | -22,617.18 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.8.2 泓德泓利货币B

单位：人民币元

| 项目 (泓德泓利货币B) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------|-------------|-------|-------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 629,508.12 | - | 629,508.12 |
| 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 | -629,508.12 | - | -629,508.12 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.8.3 泓德泓利货币C

单位：人民币元

| 项目 (泓德泓利货币C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------|---------|-------|---------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 149.59 | - | 149.59 |
| 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 | -149.59 | - | -149.59 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 2,950.43 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |

| | |
|----|----------|
| 其他 | - |
| 合计 | 2,950.43 |

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 709,233.23 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | - |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 709,233.23 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 200,400,000.00 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 200,000,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 400,000.00 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | - |

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.14 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.15 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 审计费用 | 22,315.49 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 5,818.27 |
| 账户维护费 | 17,280.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 105,521.13 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|-----------------------|
| 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 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

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。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 107,590.78 | 268,059.07 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 474.12 | 1,519.34 |

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 34,429.05 | 85,778.91 |

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售 服务费的 各关联方 名称 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | | |
|----------------------------|------------------------------------|-----------|---------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
| | 泓德泓利货币A | 泓德泓利货币B | 泓德泓利货币C | 合计 |
| 泓德基金 | 3,259.39 | 4,122.63 | 28.87 | 7,410.89 |
| 交通银行 | 280.86 | 0.00 | 0.00 | 280.86 |
| 合计 | 3,540.25 | 4,122.63 | 28.87 | 7,691.75 |
| 获得销售 服务费的 各关联方 名称 | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 | | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
| | 泓德泓利货币A | 泓德泓利货币B | 泓德泓利货币C | 合计 |
| 泓德基金 | 4,151.51 | 10,367.29 | 0.00 | 14,518.80 |
| 交通银行 | 381.46 | 0.00 | 0.00 | 381.46 |
| 合计 | 4,532.97 | 10,367.29 | 0.00 | 14,900.26 |

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%的年费率计提，B类份额按前一日基金资产净值0.01%的年费率计提，C类份额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X0.25%/当年天数。

B类份额日销售服务费=前一日基金资产净值X0.01%/当年天数。

C类份额日销售服务费=前一日基金资产净值X0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

泓德泓利货币A

份额单位：份

| 项目 | 本期 2023年01月01日至 2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日 |
|---------------------|-----------------------------------|--|
| 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 2023年01月01日至 2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日 |
|---------------------|-----------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额 | 0.00 | 50,621,635.38 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 80,266,214.94 | 567,334.75 |
| 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 | 30,000,000.00 | 51,188,970.13 |
| 报告期末持有的基金份额 | 50,266,214.94 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 49.21% | 0.00% |

泓德泓利货币C

份额单位：份

| 项目 | 本期 2023年01月01日至 2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 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% |
|---------------------|-------|-------|

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额；上年度可比期间申购/买入总份额为红利再投份额。

2. 期间赎回/卖出总份额为基金转换（出）份额。

3. 基金管理人泓德基金管理有限公司在本年度及上年度可比期间申购/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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|-------|-------------------------------|----------|------------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行 | 1,417,281.97 | 2,950.43 | 20,659,528.69 | 3,301.51 |

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

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。

6.4.11 利润分配情况

泓德泓利货币A

单位：人民币元

| 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润 分配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 22,700.93 | - | -83.75 | 22,617.18 | - |

泓德泓利货币B

单位：人民币元

| 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润 分配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 630,950.86 | - | -1,442.74 | 629,508.12 | - |

泓德泓利货币C

单位：人民币元

| 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润 分配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 150.57 | - | -0.98 | 149.59 | - |

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | - | 24,955,906.30 |
| 合计 | - | 24,955,906.30 |

注：于2022年12月31日，未评级部分为国债。债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金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。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | 49,918,503.84 | 89,767,909.87 |
| 合计 | 49,918,503.84 | 89,767,909.87 |

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | - | - |
| AAA以下 | - | - |
| 未评级 | 10,285,140.52 | - |
| 合计 | 10,285,140.52 | - |

注：于2023年6月30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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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(净资产)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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等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99.33%，本基金投资组合的平均剩余期限为18天，平均剩余存续期为18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50.96%。

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%。于本报告期末，本基金持有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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023年0 6月30 日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|---------------|--------|------|------|-----|---------------|
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 1,417,281.97 | - | - | - | - | 1,417,281.97 |
| 交易性金融资产 | 60,203,644.36 | - | - | - | - | 60,203,644.36 |
| 买入返 | 40,652,150.64 | - | - | - | - | 40,652,150.64 |

| | | | | | | |
|---------------------|----------------|--------|------|------|-------------|----------------|
| 售金融资产 | | | | | | |
| 资产总计 | 102,273,076.97 | - | - | - | - | 102,273,076.97 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 15,081.92 | 15,081.92 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 4,826.20 | 4,826.20 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 1,035.05 | 1,035.05 |
| 应付利润 | - | - | - | - | 5,520.86 | 5,520.86 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 100,252.55 | 100,252.55 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 126,716.58 | 126,716.58 |
| 利率敏感度缺口 | 102,273,076.97 | - | - | - | -126,716.58 | 102,146,360.39 |
| 上年度末 2022年12月31日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 237,058.57 | - | - | - | - | 237,058.57 |
| 交易性金融资产 | 114,723,816.17 | - | - | - | - | 114,723,816.17 |
| 买入返售金融资产 | 26,005,052.80 | - | - | - | - | 26,005,052.80 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 1,003.00 | 1,003.00 |
| 资产总计 | 140,965,927.54 | - | - | - | 1,003.00 | 140,966,930.54 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 29,885.40 | 29,885.40 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 9,563.31 | 9,563.31 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 2,073.39 | 2,073.39 |
| 应付利润 | - | - | - | - | 7,048.33 | 7,048.33 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 66,080.87 | 66,080.87 |

| | | | | | | |
|---------|----------------|---|---|---|-------------|----------------|
| 负债总计 | - | - | - | - | 114,651.30 | 114,651.30 |
| 利率敏感度缺口 | 140,965,927.54 | - | - | - | -113,648.30 | 140,852,279.24 |

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|---------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元) | |
| | | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 市场利率下降25个基点 | 11,539.95 | 34,357.01 |
| | 市场利率上升25个基点 | -11,534.84 | -34,332.97 |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 60,203,644.36 | 114,723,816.17 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 60,203,644.36 | 114,723,816.17 |

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|----|----------|---------------|--------------|
| 1 | 固定收益投资 | 60,203,644.36 | 58.87 |
| | 其中：债券 | 60,203,644.36 | 58.87 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 40,652,150.64 | 39.75 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 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 | 1,417,281.97 | 1.39 |
| 4 | 其他各项资产 | - | - |
| 5 | 合计 | 102,273,076.97 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例(%) | |
|----|--------------|--------------|--------------|
| 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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 18 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 56 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 17 |

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。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资 | 各期限负债占基金资 |
|----|--------|-----------|-----------|
|----|--------|-----------|-----------|

| | | 产净值的比例(%) | 产净值的比例(%) |
|---|----------------------|-----------|-----------|
| 1 | 30天以内 | 80.29 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 19.83 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | - | - |
| | 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 | 100.12 | - |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内平均剩余存续期未超过240天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,285,140.52 | 10.07 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,285,140.52 | 10.07 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |

| | | | |
|----|--------------------|---------------|-------|
| 7 | 同业存单 | 49,918,503.84 | 48.87 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 60,203,644.36 | 58.94 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 200407 | 20农发07 | 100,000 | 10,285,140.52 | 10.07 |
| 2 | 112217138 | 22光大银行C D138 | 100,000 | 9,990,652.55 | 9.78 |
| 3 | 112214108 | 22江苏银行C D108 | 100,000 | 9,987,898.84 | 9.78 |
| 4 | 112397239 | 23广州农村商 业银行CD051 | 100,000 | 9,986,677.14 | 9.78 |
| 5 | 112208078 | 22中信银行C D078 | 100,000 | 9,983,614.28 | 9.77 |
| 6 | 112204028 | 22中国银行C D028 | 100,000 | 9,969,661.03 | 9.76 |

注：本基金本报告期末仅持有六只债券。

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0387% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0233% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0123% |

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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金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。

7.9.2 报告期内本基金投资的前十名证券除22江苏银行CD108（证券代码：112214108）、22中国银行CD028（证券代码：112204028）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2023年02月06日，22江苏银行CD108（证券代码：112214108）发行人江苏银行股份有限公司因违反账户管理规定、违反流通人民币管理规定、违反人民币反假有关规定、占压财政存款或者资金等被中国人民银行警告，没收违法所得42元，罚款773.6万元。

2023年06月14日，22中国银行CD028（证券代码：112204028）发行人中国银行股份有限公司因违反规定从事未经批准的业务活动、违规超授权交易、同业业务超期限被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚没款共计696.9076万元。

2023年02月16日，22中国银行CD028（证券代码：112204028）发行人中国银行股份有限公司因小微企业贷款风险分类不准确、小微企业贷款资金被挪用于房地产领域、贷款资金被挪用于证券市场、小微企业贷款资金被挪用于购买本行理财等被中国银行保险监督管理委员会罚款3280万元,其中对总行罚款1600万元，对分支机构罚款1680万元。

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他分析，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。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合本基金管理人投资管理制度的规定。

7.9.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额 级别 | 持 有 人 户 数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|-----------------|------------------------------|---------------|----------------|----------------|--------------|-------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总 份额 比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 泓德 泓利 货币A | 377 | 5,743.69 | 1,159,987.69 | 53.5 7% | 1,005,382.53 | 46.43% |
| 泓德 泓利 货币B | 5 | 19,993,029.27 | 99,965,146.35 | 100.0 0% | 0.00 | 0.00% |
| 泓德 泓利 货币C | 19 | 833.89 | 0.00 | 0.00% | 15,843.82 | 100.0 0% |
| 合计 | 400 | 255,365.90 | 101,125,134.04 | 99.0 0% | 1,021,226.35 | 1.00% |

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）。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额(份) | 占总份额比例 |
|----|-------|---------------|--------|
| 1 | 基金类机构 | 50,266,214.94 | 49.21% |
| 2 | 基金类机构 | 30,012,745.87 | 29.38% |
| 3 | 基金类机构 | 8,681,512.05 | 8.50% |
| 4 | 基金类机构 | 6,002,549.18 | 5.88% |
| 5 | 基金类机构 | 5,002,124.31 | 4.90% |

| | | | |
|----|-------|--------------|-------|
| 6 | 基金类机构 | 1,147,924.01 | 1.12% |
| 7 | 个人 | 104,445.13 | 0.10% |
| 8 | 个人 | 88,047.84 | 0.09% |
| 9 | 个人 | 86,171.25 | 0.08% |
| 10 | 个人 | 72,649.14 | 0.07% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比 例 |
|------------------|---------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 泓德泓利货币A | 2,269.27 | 0.1048% |
| | 泓德泓利货币B | 0.00 | 0.0000% |
| | 泓德泓利货币C | 15,642.22 | 98.7276% |
| | 合计 | 17,911.49 | 0.0175% |

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）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|---------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 泓德泓利货币A | 0~10 |
| | 泓德泓利货币B | 0 |
| | 泓德泓利货币C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 泓德泓利货币A | 0 |
| | 泓德泓利货币B | 0 |
| | 泓德泓利货币C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§9 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 | 泓德泓利货币C |
|----------------------------|--------------|----------------|-----------|
| 基金合同生效日(2015年12月21日)基金份额总额 | 1,821,128.84 | 241,000,000.00 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,279,025.23 | 136,533,398.35 | 39,855.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 337,398.55 | 121,653,351.93 | 150.57 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,451,053.56 | 158,221,603.93 | 24,162.41 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,165,370.22 | 99,965,146.35 | 15,843.82 |

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。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动

2023年2月21日，本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，邬传雁离任公司副总经理；2023年5月18日，本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，温永鹏转任公司董事长，不再担任副总经理职务，胡康宁离任董事长。

(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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司及其高级管理人员被中国证监会、基金业协会、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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 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

10.7.2 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 | - | - | - | - | - | - | - | - |

10.8 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。

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-------------------------|------------|
| 1 | 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 | 2023-01-18 |
| 2 | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券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 | 2023-02-17 |
| 3 | 泓德基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-21 |

| | | | |
|----|---|-------------------------|------------|
| 4 | 泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与部分销售机构基金转换费率优惠活动的公告 | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-24 |
| 5 | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安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 | 2023-02-25 |
| 6 | 泓德基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在销售机构申购起点金额的公告 | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-02 |
| 7 | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买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 | 2023-03-23 |
| 8 | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加珠海盈米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 | 2023-03-23 |
| 9 | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加浙江同花顺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 | 2023-04-25 |
| 10 | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加济安财富（北京）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 | 2023-04-25 |
| 11 | 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 | 2023-04-26 |
| 12 | 泓德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 公司官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-05-18 |

| | | | |
|----|--|-------------------------|------------|
| 13 | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券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 | 2023-05-26 |
|----|--|-------------------------|------------|

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2023/06/21-2023/06/30 | 0.00 | 30,012,745.87 | 0.00 | 30,012,745.87 | 29.38% |
| | 2 | 2023/02/17-2023/06/30 | 0.00 | 80,266,214.94 | 30,000,000.00 | 50,266,214.94 | 49.21% |
| | 3 | 2023/01/01-2023/02/22 | 52,015,162.95 | 122,076.34 | 52,137,239.29 | 0.00 | 0.00% |
| | 4 | 2023/01/01-2023/02/16 | 45,326,604.21 | 97,725.59 | 45,424,329.80 | 0.00 | 0.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 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

12.3 查阅方式

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

泓德基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日