泓德泓利货币市场基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年08月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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2018年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	397,462,896.95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	16,061,223.49份	381,401,673.46份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	陆志俊
	联系电话	010-59850177	95559
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4009-100-888	95559
传真		010-59322130	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hongdefund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	泓德泓利货币A	泓德泓利货币B
本期已实现收益	434,201.00	6,352,051.44
本期利润	434,201.00	6,352,051.44
本期净值收益率	1.9923%	2.1144%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末基金资产净值	16,061,223.49	381,401,673.46
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现与本期利润相等。@2、基金利润分配按日结转份额。

3.2 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

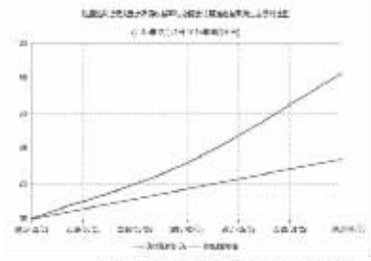
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3225%	0.0017%	0.1110%	0.0000%	0.2115%	0.0017%
过去三个月	0.9673%	0.0013%	0.3366%	0.0000%	0.6307%	0.0013%
过去六个月	1.9923%	0.0024%	0.6695%	0.0000%	1.3228%	0.0024%
过去一年	3.9986%	0.0030%	1.3500%	0.0000%	2.6486%	0.0030%
自基金合同生效起至今	8.2815%	0.0030%	3.4138%	0.0000%	4.8677%	0.0030%

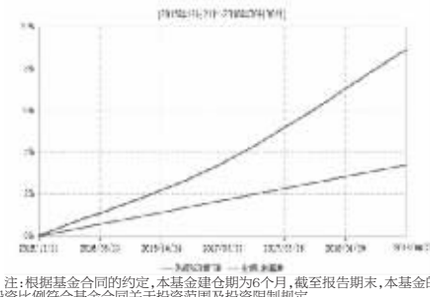
泓德泓利货币B

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	0.3423%	0.0017%	0.1110%	0.0000%	0.2313%	0.0017%
过去三个月	1.0279%	0.0013%	0.3366%	0.0000%	0.6913%	0.0013%
过去六个月	2.1144%	0.0024%	0.6695%	0.0000%	1.4449%	0.0024%
过去一年	4.2491%	0.0030%	1.3500%	0.0000%	2.8991%	0.0030%
自基金合同生效起至今	8.9421%	0.0030%	3.4138%	0.0000%	5.5283%	0.0030%

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

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





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。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2018年6月30日,公司总资产管理规模为361.11亿元,其中公募基金管理规模194.95亿元,专户产品管理规模166.16亿元。2018年上半年,公司新发行1只混合型公募基金产品。公司自成立起至2018年6月30日,公司累计发行了21只公募基金产品,其中混合型11只,包括泓德优选成长混合、泓德泓富混合、泓德远见回报混合、泓德泓业混合、泓德泓益量化混合、泓德泓信混合、泓德泓汇混合、泓德泓华混合、泓德优势领航混合、泓德致远混合、泓德臻远回报混合;股票型基金1只,具体为泓德战略转型股票;债券型基金7只,具体包括泓德裕泰债券、泓德裕康债券、泓德裕荣纯债、泓德裕和纯债、泓德裕祥债券、泓德裕泽一年定开债券、泓德裕鑫一年定开债券;货币基金2只,具体为泓德泓利货币、泓德添利货币。同时,公司管理多只特定客户资产管理计划。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邹传雁	公司副总经理、事业二部总监,现任泓德泓富混合、泓德远见回报混合、泓德泓业混合、泓德裕泰债券、泓德泓利货币、泓德臻远回报混合基金的基金经理。	2016-12-21	-	18年	硕士研究生,具有基金从业资格,曾任幸福人寿保险股份有限公司总裁助理兼投资管理中心总经理,阳光保险集团股份有限公司资产投资管理中心投资负责人,阳光财产保险股份有限公司资金运用部总经理助理,光大永明人寿保险公司投资部投资分析主管,光大证券股份有限公司研究所分析师,华泰财产保险公司投资管理中心基金部副经理。
李倩	现任泓德泓利货币、泓德裕泰债券、泓德泓富混合、泓德泓业混合、泓德裕康债券、泓德裕荣纯债债券、泓德裕和纯债债券、泓德裕祥债券、泓德添利货币、泓德裕泽一年定开债券、泓德裕鑫一年定开债券、泓德裕华混合基金的基金经理。	2016-12-21	-	9年	硕士研究生,具有基金从业资格,曾任中国农业银行股份有限公司金融市场部、资产管理部理财组合投资经理,中信建投证券股份有限公司资产管理部债券交易员、债券投资经理助理。

注:1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期,对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。@2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《泓德泓利货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年受走强的经济基本面、严格的资管新规以及紧缩的货币政策等因素的影响,债券市场收益率持续上行,收益率曲线平坦。而2018年初以来,在流动性宽松、地缘政治风波、股市调整等因素的影响下中国债券市场收益率整体收益率水平大幅下行,曲线增陡。

2018年年初受监管政策密集出台的影响,10年期国债收益率曾上行至3.98%附近,但这也是半年内收益率最高点,之后一路下行至4月初的3.7%左右,收益率下行最先受益于流动性的边际宽松,包括1月25日开始实施的普惠金融定向降准以及春节期间的临时准备金动用安排(CRA)等。3月初,中美贸易争端开启,金融市场短期风险偏好骤降,同时市场开始担忧国内需求回落的风险,也带动了国内债市收益率继续下行。4月17日央行公布年内第二次降准,利率债收益率急速下行,但未来流动性宽裕的预期被消耗,之后直到6月中旬债市基本处于震荡整理阶段。而随着中美贸易战的升级以及6月24日央行公布年内第三次降准,6月中下旬开始利率债收益率继续下行。而受资金面全面宽松的影响,2018年存款和存单发行利率趋势性下行。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,泓德泓利货币A基金净值收益率为1.9923%,泓德泓利货币B基金净值收益率为2.1144%,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

4.5.1 宏观经济和证券市场展望

货币政策方面,政策基调从2017年的基本稳定,到2018年前5个月的合理稳定,到目前的合理充裕,对应偏紧、中性、偏松。在中美贸易摩擦、严监管导致的信用收缩过程中"宽货币"能起到对冲、安抚、应急的作用,预计后期资金面将继续维持宽松。

监管政策方面,7月20日,央行发布《关于进一步明确规范金融机构资产管理业务指导意见有关事项的通知》,是对4月份发布的资管新规的重要补充,主要针对过渡期安排进行了适当放松,增强实践中的可操作性。同日,中国银保监会就《商业银行理财业务监督管理办法(征求意见稿)》公开征求意见,是根据资管新规在银行理财领域的细化要求。本次政策出台,是一个积极变化,使得资管新规更具可操作性,通过放缓存量业务调整速度、减少企业继续通过非标融资的难度,来改善企业融资环境,信用市场面临的融资缺口问题预期将逐步改善。

基本面方面,二季度GDP同比增速小幅回落,其中消费带动作用加强,净出口持续走弱;6月工业增加值增速大幅回落,固定资产投资累计增速小幅下行、基建投资持续大幅下降,预计三季度下行压力仍将持续,而受益于监管政策的变化,"紧信用"格局预计将边际缓和,有利于市场风险偏好的提升,但实体融资成本短期仍将维持高位。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

基金经理参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定,本基金按日分配收益,自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人,并按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,2018年上半年度泓利货币A分配利润434,201.00元,泓利货币B分配利润6,352,051.44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

2018年上半年度,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

2018年上半年度,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:434,201.00元,向B级份额持有人分配利润:6,352,051.44元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2018年上半年度,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半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 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:2018年06月30日

单位:人民币元

资 产?	本期末? 2018年06月30日?	上年度末? 2017年12月31日?
资 产:	?	?
银行存款	53,004,697.47	169,006,545.22
结算备付金	160,000.00	1,900,000.00
存出保证金	-	-
交易性金融资产	208,557,693.88	138,685,965.28
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	208,557,693.88	138,685,965.28
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	134,580,761.88	32,000,288.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,410,536.36	2,131,541.93
应收股利	-	-?
应收申购款	-	619.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	397,713,689.59	343,724,960.08
负债和所有者权益	本期末? 2018年06月30日	上年度末? 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	65,438.82	79,532.11
应付托管费	20,940.40	25,450.28
应付销售服务费	5,801.73	13,477.47
应付交易费用	16,597.70	9,667.44
应交税费	1,004.64	-
应付利息	-	-
应付利润	55,641.83	44,134.92
递延所得税负债	-	-
其他负债	85,367.52	81,000.00
负债合计	250,792.64	253,262.22
所有者权益:	?	?
实收基金	397,462,896.95	343,471,697.86
未分配利润	-	-
所有者权益合计	397,462,896.95	343,471,697.86
负债和所有者权益总计	397,713,689.59	343,724,960.08

注:报告截止日2018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397,462,896.95份。其中泓德泓利货币市场基金A类份额16,061,223.49份,泓德泓利货币市场基金B类份额381,401,673.46份。

6.2 利润表

会计主体:泓德泓利货币市场基金
本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期2018年01月01日至2018年06月30日?	上年度可比期间? 2017年01月01日至2017年06月30日?
一、收入	7,558,344.09	22,065,845.11
1.利息收入	7,473,390.97	22,067,032.29
其中:存款利息收入	3,531,391.82	9,978,236.99
债券利息收入	2,788,138.62	9,459,751.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,153,860.53	2,629,044.21
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	84,953.12	-1,187.18
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	84,953.12	-1,187.18
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	772,091.65	2,845,755.92
1. 管理人报酬	403,082.53	1,448,641.37
2. 托管费	128,986.39	463,565.19
3. 销售服务费	42,239.74	72,113.08
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	93,314.57	735,923.78
其中:卖出回购金融资产支出	93,314.57	735,923.78
6. 税金及附加	679.19	-
7. 其他费用	103,789.23	125,512.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	6,786,252.44	19,220,089.19
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	6,786,252.44	19,220,089.19

6.3 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:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期? 2018年01月01日至2018年06月30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)	343,471,697.86	-	343,471,697.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,786,252.44	6,786,252.44
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)	53,991,199.09	-	53,991,199.09
其中:1.基金申购款	481,165,341.70	-	481,165,341.70
2.基金赎回款	-427,174,142.61	-	-427,174,142.61
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)	-	-6,786,252.44	-6,786,252.44
五、期末所有者权益(基金净值)	397,462,896.95	-	397,462,896.95
项 目	上年度可比期间? 2017年01月01日至2017年06月30日?		
	实收基金?	未分配利润?	所有者权益合计?
一、期初所有者权益(基金净值)	2,295,101,023.84	-	2,295,101,023.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,220,089.19	19,220,089.19
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)	-1,692,947,722.80	-	-1,692,947,722.80
其中:1.基金申购款	1,225,083,560.12	-	1,225,083,560.12
2.基金赎回款	-2,918,031,282.92	-	-2,918,031,282.92
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)	-	-19,220,089.19	-19,220,089.19
五、期末所有者权益(基金净值)	602,153,301.04	-	602,153,301.04

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	王德晓	李娇
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

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》核准,由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币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。

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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(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业务操作编制。

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2018年01月01日至2018年06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2018年06月30日的财务状况以及2018年01月01日至2018年06月30日止期间的经营成果和基金净值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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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费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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	403,082.53	1,448,641.37
其中:支付销售机构的客户维护费	6,390.08	444.98

注:支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:@日管理人报酬=前一日基金资产净值X0.25%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	128,986.39	463,565.19

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X0.08%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018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	合计
泓德基金	10,124.58	15,035.17	25,159.75
交通银行	3,645.83	-	3,645.83
合计	13,770.41	15,035.17	28,805.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017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	合计
泓德基金	13,357.91	57,241.55	70,599.46
合计	13,357.91	57,241.55	70,599.46

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,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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

泓德泓利货币A

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

泓德泓利货币B

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	57,366,245.19
报告期间申购/买入总份额	-	36,117,041.40
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-42,500,000.00
报告期末持有的基金份额	-	50,983,286.59
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	8.47%

注:1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。@2、基金管理人泓德基金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。@3、本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017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-活期存款	4,697.47	174.47	4,558.04	57.21
交通银行-定期存款	-	239,633.67	90,000,000.00	129,600.00

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销