新华活期添利货币市场基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:新华基金管理股份有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年三月二十八日

§1 重要提示

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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华活期添利货币		
基金主代码	000903		
交易代码	000903		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年12月4日		
基金管理人	新华基金管理股份有限公司		
基金托管人	平安银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	11,056,597,887.16份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	新华活期添利A	新华活期添利B	新华活期添利E
下属分级基金的交易代码	000903	003264	005148
报告期末下属分级基金的份额总额	6,413,396,345.77份	4,146,714,201.17份	496,487,340.22份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上, 追求超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金采取以长期利率趋势分析为基础,结合短中期经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券类属配置和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资组合管理。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其预期风险与预期收益均低于一般债券基金,也低于混合型基金与股票型基金。

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		新华基金管理股份有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	李婵婵
	联系电话	010-68779688	0755-25878287
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	LISHUAISHUA1130@pingan.com.cn
客户服务电话		4008198866	95511-3
传真		010-68779628	0755-82080387

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年			2017年			2016年		
	新华活期添利A	新华活期添利B	新华活期添利E	新华活期添利A	新华活期添利B	新华活期添利E	新华活期添利A	新华活期添利B	新华活期添利E
本期已实现收益	259,491,833.85	141,480,212.97	15,688,864.13	75,233,531.54	39,274,327.96	2,222,490.26	5,995,956.95	11,568,238.94	-
本期利润	259,491,833.85	141,480,212.97	15,688,864.13	75,233,531.54	39,274,327.96	2,222,490.26	5,995,956.95	11,568,238.94	-
本期净值收益率	3.8871%	4.1365%	4.0949%	4.0390%	4.2877%	1.3919%	2.5535%	1.0192%	-
3.1.2 末数据和指标	2018年末			2017年末			2016年末		
	新华活期添利A	新华活期添利B	新华活期添利E	新华活期添利A	新华活期添利B	新华活期添利E	新华活期添利A	新华活期添利B	新华活期添利E
期末基金资产净值	6,413,396,345.77	4,146,714,201.17	496,487,340.22	4,291,889,590.96	2,430,659,719.23	325,909,759.57	630,829,153.92	1,510,142,818.74	-
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	-

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,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按日结转份额。

3. 本基金2016年8月29日分为A类 (基金代码:000903)、B类 (基金代码:003264)。

4.本基金于2017年9月7日新增E类(基金代码:005148)。

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

1. 新华活期添利A:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7811%	0.0008%	0.3408%	0.0000%	0.4403%	0.0008%
过去六个月	1.7362%	0.0013%	0.6829%	0.0000%	1.0533%	0.0013%
过去一年	3.8871%	0.0015%	1.3591%	0.0000%	2.5280%	0.0015%
过去三年	10.8431%	0.0045%	4.1331%	0.0000%	6.7100%	0.0045%
自基金合同生效起至今	14.8632%	0.0045%	5.6577%	0.0000%	9.2055%	0.0045%

2. 新华活期添利B:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8422%	0.0008%	0.3408%	0.0000%	0.5014%	0.0008%
过去六个月	1.8594%	0.0013%	0.6829%	0.0000%	1.1765%	0.0013%
过去一年	4.1365%	0.0015%	1.3591%	0.0000%	2.7774%	0.0015%
自基金合同生效起至今	9.7083%	0.0033%	3.2115%	0.0000%	6.4968%	0.0033%

3. 新华活期添利E:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8320%	0.0008%	0.3408%	0.0000%	0.4912%	0.0008%
过去六个月	1.8389%	0.0013%	0.6829%	0.0000%	1.1560%	0.0013%
过去一年	4.0949%	0.0015%	1.3591%	0.0000%	2.7358%	0.0015%
自基金合同生效起至今	5.5437%	0.0015%	1.7949%	0.0000%	3.7488%	0.0015%

注:1.本基金利润分配是按日结转份额。

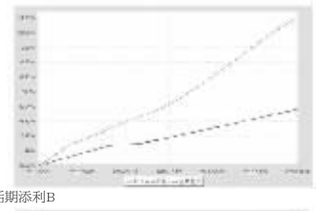
2.本基金于2016年8月29日分为A类(基金代码:000903)、B类(基金代码:003264)。

3.本基金于2017年9月7日新增E类(基金代码:005148)。

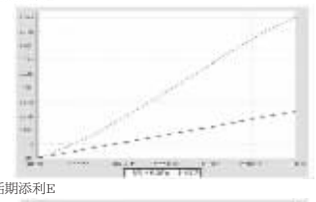
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华活期添利货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2014年12月4日至2018年12月31日)

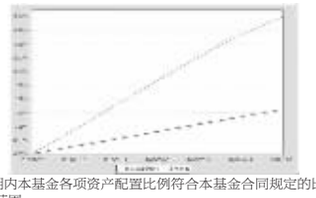
1、新华活期添利A



2、新华活期添利B



3、新华活期添利E



注:1. 告期内本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

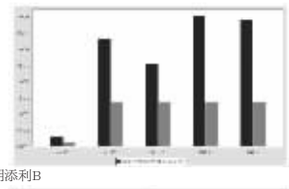
2.本基金于2016年8月29日分为A类(基金代码:000903)、B类(基金代码:003264)。

3.本基金于2017年9月7日新增E类(基金代码:005148)。

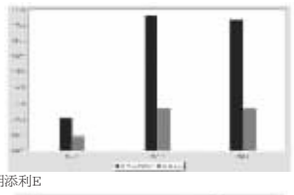
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华活期添利货币市场基金
自基金合同生效以来基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

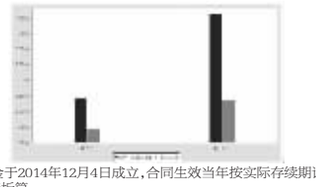
1、新华活期添利A



2、新华活期添利B



3、新华活期添利E



注:1.本基金于2014年12月4日成立,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

2.本基金于2016年8月29日分为A类(基金代码:000903)、B类(基金代码:003264)。

3.本基金于2017年9月7日新增E类(基金代码:005148)。

3.3过去三年基金的利润分配情况

新华活期添利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
2016年	5,898,868.02	-	97,088.93	5,995,956.95	-
2017年	73,810,799.59	-	1,422,731.95	75,233,531.54	-
2018年	258,098,074.07	-	393,759.78	258,491,833.85	-
合计	337,807,741.68	-	1,913,580.66	339,721,322.34	-

新华活期添利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
2016年	11,292,947.06	-	275,291.88	11,568,238.94	-
2017年	38,634,607.56	-	639,720.40	39,274,327.96	-
2018年	141,042,400.47	-	437,812.50	141,480,212.97	-
合计	190,969,955.09	-	1,352,824.78	192,322,779.87	-

新华活期添利E:

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2017年	2,100,881.57	-	121,608.69	2,222,490.26	-
2018年	15,650,695.52	-	38,168.61	15,688,864.13	-
合计	17,751,577.09	-	159,777.30	17,911,354.39	-

注:1.本基金于2014年12月4日成立,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

2.本基金于2016年8月29日分为A类(基金代码:000903)、B类(基金代码:003264)。

3.本基金于2017年9月7日新增E类(基金代码:005148)。

§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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复,于2004年12月9日注册成立。注册地为重庆市,是我国西部首家基金管理公司。

截至2018年12月31日,新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十五只开放式基金,即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华精选低波动股票型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金、新华安享惠钰定期开放债券型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
王滨	本基金基金经理,固定收益与平衡投资部副总监,新华鑫诺宝货币市场基金基金经理、新华精选低波动股票型证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理。	2017-07-26	-	11	管理学硕士,历任中国工商银行总行固定收益投资经理、中国民生银行投资经理、民生加银基金管理有限公司基金经理、新华基金管理股份有限公司投资经理。
李洁	本基金基金经理助理,新华鑫诺宝货币市场基金基金经理助理。	2017-06-05	-	5	经济学硕士,历任中债信用业务经理、高级经理,新华基金债券研究员。

注:1、首任基金经理,任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理,任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券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,新华基金管理股份有限公司作为新华活期添利货币市场基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华活期添利货币市场基金基金合同》以及其它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持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。场内交易,投资指令统一由交易部下达,并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度,严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。场外交易中,对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易, 交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议,由交易部投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部,再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要,可以召开风险管理委员会会议,对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令,交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定。基金管理人对旗下所有投资组合间连续4个季度的日内、3日内以及5日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明:债券同向交易频率偏低;股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断,即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大,结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生,本报告期内,未发生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成交量超过该证券当日成交量的5%的情况

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

2018年全年国内生产总值同比增长6.6%,较2017年回落0.2个百分点,经济增速放缓的主要原因在于:资管新规下金融和实体去杠杆对基建投资、房地产投资造成了较大的影响,固定资产投资增速明显回落;房地产下游关联行业陷入颓势,汽车类消费下滑严重带动社零增速继续下行。外部环境上,中美贸易摩擦使得市场对经济表现悲观预期增强,通过产业链传导的形式也拖累了部分制造业。货币政策全年呈现了适度宽松的基调,央行在1月、4月、7月和10月先后实施了四次定向降准。非标融资的急剧收缩使得社融规模显著下降,经济下行压力加大,下半年以来货币政策进一步向宽信用和稳杠杆转变。

受益于经济下行预期增强、市场流动性逐步宽裕、避险情绪升温的影响,2018年全年债券市场呈现牛市行情,短端下降更为明显。1年期国债、国开债收益率分别下行107BP、173BP至2.60%和2.75%,10年期国债、国开债收益率分别下行67BP、123BP至3.23%和3.64%。信用债方面,违约事件增多,市场风险偏好降低,高等级信用债收益率下行显著,但中低等级信用债整体利差处于历史中高水平。

本报告期内,基金规模稳步上升,本基金依然秉持稳健投资原则谨慎操作,以确保组合安全性为首要任务,保障组合充足流动性,同时根据规模及配置时点合理调整各类资产配置比例, 在提供充分流动性保证的情况下为持有人获取了较好的投资回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内(A类)基金份额净值收益率为3.8871%,同期业绩比较基准收益率为1.3591%;本基金本报告期内(B类)基金份额净值收益率为4.1365%,同期业绩比较基准收益率为1.3591%;本基金本报告期内(E类)基金份额净值收益率为4.0949%,同期业绩比较基准收益率为1.3591%。

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2019年, 在我国经济由高速增长阶段向高质量发展阶段的转变过程中,经济结构转型趋势仍然在延续,经济增速仍然面临一定的回落压力。需求上看,房地产投资周期性难言好转,基建投资托而不举,外需减弱使得出口仍然面临较大的不确定性。宽信用的传导需要宽货币的支持,在信贷和社融规模明显回升之前,预计货币政策将继续保持稳健偏松。尽管基本面和货币政策整体环境有利债市,但考虑到前期对经济的悲观预期较充分以及无风险利率整体处于历史地位水平, 债券收益率可能缺乏持续大幅下行的动力,预计全年将维持震荡走势。此外,我们需关注政策调控力度加大带来经济改善、通胀上升以及风险类资产回暖导致风险偏好回升的风险。

本基金在投资策略上将结合市场表现与流动性要求, 采取较为灵活的策略应对收益率变化,重点把握资金面波动时点,投向存单、存款、回购和短融等,在提供充分的流动性保证的情况下为持有人获取更好的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工

4.7.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责:

① 制定估值制度并在必要时修改;
② 确保估值方法符合现行法规;
③ 批准证券估值的步骤和方法;
④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长, 运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下,可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

4.7.1.2 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后, 基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告,至少每月一次。

基金会计职责:

① 获得独立、完整的证券价格信息;
② 每日证券估值;
③ 检查价格波动并进行一般准确性评估;
④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动, 并在必要时向估值工作小组报告;
⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录;
⑥ 对估值调整和人工估值进行记录;
⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要,可以提议召开估值工作小组会议。

4.7.1.3 投资管理部的职责分工

① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯;
② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;
③ 评价并确认基金会计提供的估值报告;
④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.7.1.4 交易部的职责分工

① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应;
② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;
③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

4.7.1.5监察稽核部的职责分工

① 监督证券的整个估值过程;
② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;
③ 确保公司的估值制度和方法符合现行法律、法规的要求;
④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险;
⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯;
⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书(更新)等有关规定,本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人(该收益参与下一日的收益分配),并按工作日结转为相应的基金份额。报告期内,本基金A类(000903)实施利润分配的金额为258,491,833.85元,B类 (003264) 实施利润分配的金额为141,480,212.97元,E类(005148)实施利润分配的金额为15,688,864.13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

本报告期本基金未出现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的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》,基金合同及其他有关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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,本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 张伟 胡慧签字出具了瑞华审字 [2019]01360034号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:新华活期添利货币市场基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	3,519,314,523.51	437,319,361.99
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	8,112,927,319.72	5,348,557,509.29
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	8,112,927,319.72	5,348,557,509.29
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	588,528,000.00	2,149,281,605.93
应收证券清算款	-	-
应收利息	41,162,601.46	12,274,360.42
应收股利	-	-
应收申购款	100,022,257.84	88,496,333.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	12,361,954,702.53	8,035,929,171.03
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	1,294,386,498.41	980,803,049.25
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	31,002.26	5,750.00
应付管理人报酬	3,624,004.77	1,826,381.55
应付托管费	878,546.61	442,759.18
应付销售服务费	1,505,545.50	979,718.64
应付交易费用	106,592.99	92,187.83
应交税费	9,976.66	-
应付利息	909,463.43	294,810.97
应付利润	3,436,184.74	2,566,443.85
递延所得税负债	-	-
其他负债	469,000.00	469,000.00
负债合计	1,305,356,815.37	987,470,101.27
所有者权益:	-	-
实收基金	11,056,597,887.16	7,048,459,069.76
未分配利润	-	-
所有者权益合计	11,056,597,887.16	7,048,459,069.76
负债和所有者权益总计	12,361,954,702.53	8,035,929,171.03

注:注:报告截止日2018年12月31日,A类(000903)基金份额净值1.000元,基金份额6,413,396,345.77份;B类(003264)基金份额净值1.000元,基金份额4,146,714,201.17份;E类 (005148) 基金份额净值1.000元, 基金份额496,487,340.22份。

7.2 利润表

会计主体:新华活期添利货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	496,154,256.78	142,548,807.47
1.利息收入	489,896,660.68	141,303,727.30
其中:存款利息收入	68,412,956.17	18,407,580.88
债券利息收入	301,393,676.14	97,219,219.84
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	120,090,028.37	25,676,926.58
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	6,257,595.10	1,245,080.17
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,257,595.10	1,245,080.17
资产支持证券投资收益	-	-
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	80,493,344.83	25,818,457.71
1. 管理人报酬	35,941,696.07	9,215,450.34
2. 托管费	8,713,138.54	2,234,048.61
3. 销售服务费	17,638,700.02	4,663,969.26
4. 交易费用	300.42	-
5. 利息支出	17,731,876.66	9,247,589.50
其中:卖出回购金融资产支出	17,731,876.66	9,247,589.50
6. 其他费用	457,200.00	457,400.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	415,660,910.95	116,730,349.76
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	415,660,910.95	116,730,349.76

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华活期添利货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	7,048,459,069.76	-	7,048,459,069.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	415,660,910.95	415,660,910.95
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)	4,008,138,817.40	-	4,008,138,817.40
其中:1.基金申购款	41,793,588,449.75	-	41,793,588,449.75
2.基金赎回款	-37,785,449,632.35	-	-37,785,449,632.35
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)	-	-415,660,910.95	-415,660,910.95
五、期末所有者权益(基金净值)	11,056,597,887.16	-	11,056,597,887.16

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,140,971,972.66	-	2,140,971,972.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	116,730,349.76	116,730,349.76
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)	4,907,487,097.10	-	4,907,487,097.10
其中:1.基金申购款	18,428,299,939.78	-	18,428,299,939.78
2.基金赎回款	-13,520,812,842.68	-	-13,520,812,842.68
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)	-	-116,730,349.76	-116,730,349.76
五、期末所有者权益(基金净值)	7,048,459,069.76	-	7,048,459,069.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:陈重,主管会计工作负责人:张宗友,会计机构负责人:徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华活期添利货币市场基金(以下简称“本基金”)系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[2014]1114号文核准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人, 于2014年11月28日至2014年12月2日向社会公开募集,设立募集期间募集及利息结转的基金份额共计200,408,379.44份,有效认购户数为274户, 并经瑞华会计师事务所 (特殊普通合伙) 瑞华验字 [2014]第37100017号验资报告予以验证。2014年12月4日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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《证券投资基金销售管理办法》等法律法规的规定及本基金基金合同和招募说明书的约定,为满足投资者的理财需求,经与本基金托管人中国平安银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,新华基金管理股份有限公司(以下简称“本公司”)决定自2016年8月29日起增加B类基金份额,并对本基金基金合同和托管协议进行修改;自2017年9月7日起增加E类基金份额,并对本基金合同和托管协议进行修改。

根据《新华活期添利货币市场基金招募说明书》及《新华活期添利货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的货币市场工具,主要包括以下:现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、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、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。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于2019年3月27日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制,根据实际发生的交易和事项,按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》(财政部令第33号发布、财政部令第76号修订)、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定 (以下合称 “企业会计准则”),中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华活期添利货币市场基金基金合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内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

1、印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从2008年9月19日起,调整证券(股票)交易印花税征收方式,将对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据按0.1%的税率对双方当事人征收证券(股票)交易印花税,调整为单边征税,即对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据的出让按0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税,对受让方不再征税。

2、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》: 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股票、债券的转让收入免征增值税,