

渤海汇金汇添金货币市场基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 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。本年度报告已经董事会审议，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 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。

本报告期为 2018 年 01 月 01 日起至 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..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 其他指标..... | 13 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况..... | 13 |
| §4 管理人报告 | 15 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 15 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 17 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 18 |
| 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..... | 18 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 19 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 19 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 20 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 21 |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明..... | 21 |
| 4.10 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..... | 21 |
| §5 托管人报告 | 22 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 22 |
| 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..... | 22 |
| 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..... | 22 |
| §6 审计报告 | 23 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 23 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 23 |
| §7 年度财务报表 | 26 |
| 7.1 资产负债表..... | 26 |
| 7.2 利润表..... | 27 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 28 |
| 7.4 报表附注..... | 29 |
| §8 投资组合报告 | 55 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 55 |
| 8.2 债券回购融资情况..... | 55 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 56 |
| 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..... | 56 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 56 |

| | |
|---|-----------|
| 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 | 57 |
| 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 | 57 |
| 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 58 |
| 8.9 投资组合报告附注 | 58 |
| §9 基金份额持有人信息 | 60 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 60 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 | 60 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 61 |
| 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的情况 | 61 |
| §10 开放式基金份额变动 | 62 |
| §11 重大事件揭示 | 63 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 63 |
| 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 | 63 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 63 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 63 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 63 |
| 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 | 63 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 63 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 | 64 |
| 11.9 其他重大事件 | 64 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 68 |
| 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 | 68 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 68 |
| §13 备查文件目录 | 69 |
| 13.1 备查文件目录 | 69 |
| 13.2 存放地点 | 69 |
| 13.3 查阅方式 | 69 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金名称 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 | |
| 基金简称 | 汇添金货币 | |
| 场内简称 | - | |
| 基金主代码 | 004786 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 7 月 25 日 | |
| 基金管理人 | 渤海汇金证券资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 383,084,577.42 份 | |
| 基金合同存续期 | - | |
| 基金份额上市的证券交易所 | - | |
| 上市日期 | - | |
| 下属分级基金的基金简称: | 渤海汇金汇添金货币 A | 渤海汇金汇添金货币 B |
| 下属分级基金的场内简称: | - | - |
| 下属分级基金的交易代码: | 004786 | 004787 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | - | - |
| 下属分级基金的后端交易代码 | - | - |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 40,277,230.28 份 | 342,807,347.14 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金在保持投资组合高流动性的前提下，分析国内外宏观经济运行状况、资本市场资金流动性态势、金融市场运行状态、政策变动情况等方面因素，在控制投资组合平均剩余期限的条件下，合理安排投资组合期限结构，利用定性与定量分析，积极选择短期金融工具，发掘市场投资机会，实现投资组合增值。具体策略包括：</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金根据宏观经济运行状况、财政与货币政策形势、信用状况、利率走势和资金供求变化等因素的综合判断，结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征，决定债券、银行存款等各类资产的配置比例和期限匹配量，并适时进行动态调整。</p> <p>2、个券选择策略</p> <p>在个券选择上，本基金将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值，发掘出具备相对价值的个券。</p> <p>3、利率分析策略</p> <p>通过对经济增速、物价水平及国际收支等数据的研究，分析宏观经济运行</p> |

| | | |
|---------------|--|-------------|
| | <p>周期，对引起短期资金变动影响较大的财政政策、货币政策等经济政策取向进行研判，进而合理预测金融市场利率水平的变动趋势，并据此调整基金资产的配置结构。</p> <p>4、银行存款投资策略 本基金根据不同银行的银行存款收益率情况，结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析，以及对整个利率市场环境及其变动趋势的研究，在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。</p> <p>5、久期策略 久期是衡量债券利率风险的主要指标，反映了债券价格对于收益率变动的敏感程度。当预期市场短期利率上升时，本基金将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式降低组合久期，以降低组合跌价风险；当预期市场短期利率下降时，则通过增持剩余期限较长的债券等方式提高组合久期，以分享债券价格上升的收益。</p> <p>6、流动性管理策略 本基金将在流动性优先的前提下，综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、持有高流动性债券种、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。同时，本基金将密切关注投资者大额申购和赎回的需求变化规律，提前做好资金准备。</p> | |
| 业绩比较基准 | 人民币活期存款利率（税后） | |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。 | |
| | 渤海汇金汇添金货币 A | 渤海汇金汇添金货币 B |
| 下属分级基金的风险收益特征 | - | - |

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 | | 渤海汇金证券资产管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周磊 | 王永民 |
| | 联系电话 | 010-68784298 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | shenkeji@msn.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-651-5988/ 400-651-1717 | 95566 |
| 传真 | | 022-23861651 | 010-66594942 |
| 注册地址 | | 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） | 北京市西城区复兴门内大街1号 |
| 办公地址 | | 深圳市南山区海德三道19号海岸大厦西座2901室 | 北京市西城区复兴门内大街1号 |
| 邮政编码 | | 518052 | 100818 |

| | | |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 徐海军 | 陈四清 |
|-------|-----|-----|

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 | https://www.bhhjamc.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

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) | 上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 渤海汇金证券资产管理有限公司 | 天津市南开区宾水西道 8 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 期间数据和指标 | 2018 年 | | 2017 年 7 月 25 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日 | | 2016 年 | |
|---------------|--------------|----------------|---|---------------|-------------|-------------|
| | 渤海汇金汇添金货币 A | 渤海汇金汇添金货币 B | 渤海汇金汇添金货币 A | 渤海汇金汇添金货币 B | 渤海汇金汇添金货币 A | 渤海汇金汇添金货币 B |
| 本期已实现收益 | 2,488,192.82 | 5,710,526.24 | 6,694,982.38 | 6,311,990.79 | - | - |
| 本期利润 | 2,488,192.82 | 5,710,526.24 | 6,694,982.38 | 6,311,990.79 | - | - |
| 本期净值收益率 | 3.2463% | 3.4953% | 1.5987% | 1.7065% | - | - |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末 | | 2017 年末 | | 2016 年末 | |
| | 期末基金资产净值 | 342,807,347.14 | 150,928,064.50 | 83,116,399.94 | - | - |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | - | - |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2018 年末 | | 2017 年末 | | 2016 年末 | |
| | 累计净值收益率 | 4.8969% | 5.2614% | 1.5987% | 1.7065% | - |

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（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

2、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用；

3、本货币基金收益分配按日结转份额。

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

渤海汇金汇添金货币 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.6348% | 0.0031% | 0.0882% | 0.0000% | 0.5466% | 0.0031% |
| 过去六个月 | 1.3885% | 0.0028% | 0.1764% | 0.0000% | 1.2121% | 0.0028% |
| 过去一年 | 3.2463% | 0.0027% | 0.3500% | 0.0000% | 2.8963% | 0.0027% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.8969% | 0.0026% | 0.5034% | 0.0000% | 4.3935% | 0.0026% |

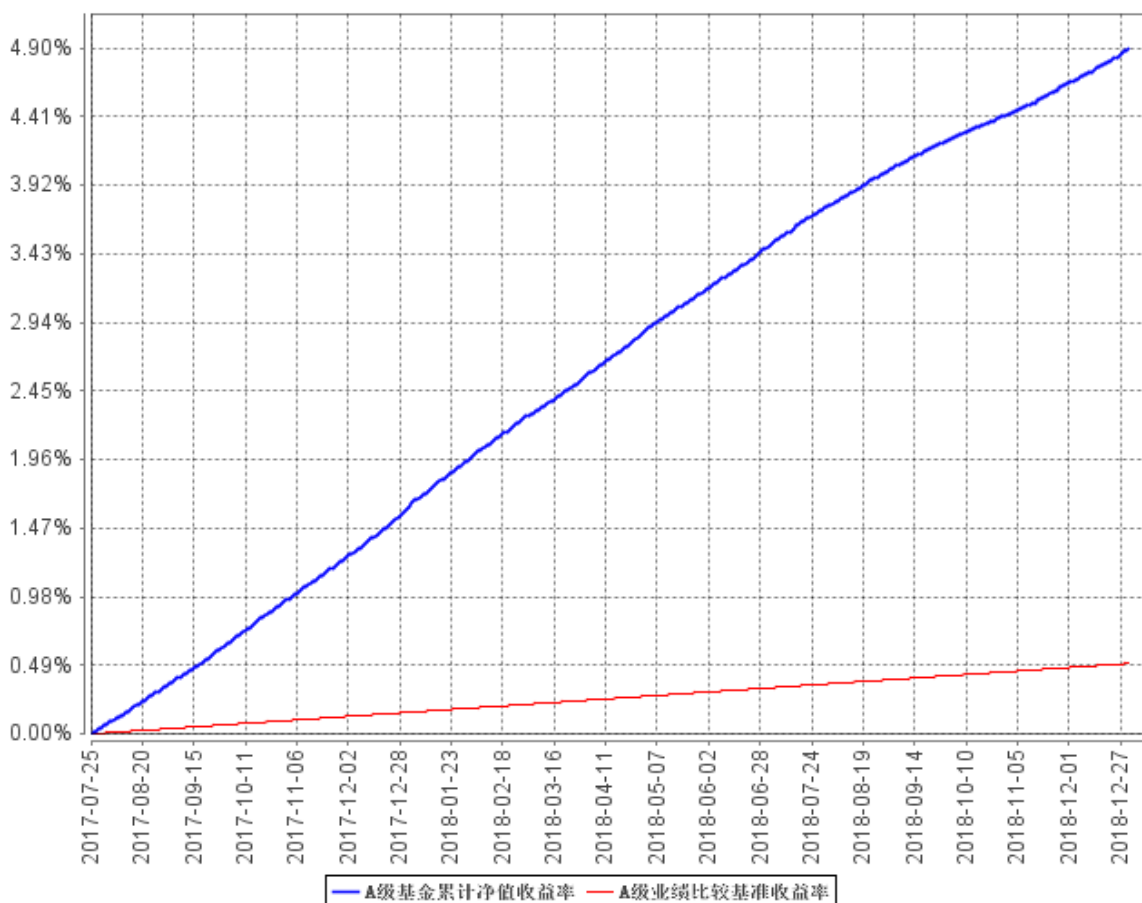
渤海汇金汇添金货币 B

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.6959% | 0.0031% | 0.0882% | 0.0000% | 0.6077% | 0.0031% |
| 过去六个月 | 1.5116% | 0.0028% | 0.1764% | 0.0000% | 1.3352% | 0.0028% |
| 过去一年 | 3.4953% | 0.0027% | 0.3500% | 0.0000% | 3.1453% | 0.0027% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.2614% | 0.0026% | 0.5034% | 0.0000% | 4.7580% | 0.0026% |

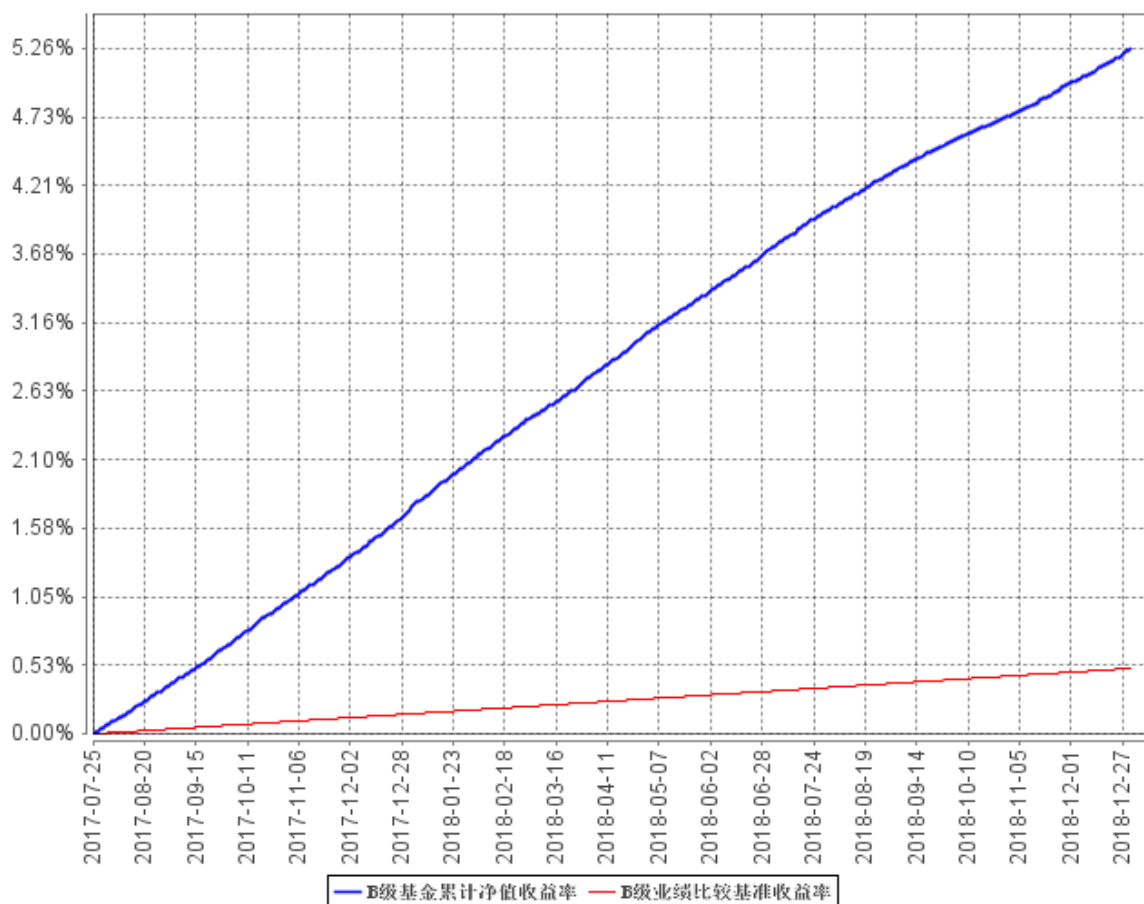
注：业绩比较基准：活期存款利率（税后）。本基金定位为现金管理工具，注重基金资产的流动性和安全性，因此采用活期存款利率（税后）作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布，如果活期存款利率或利息税发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

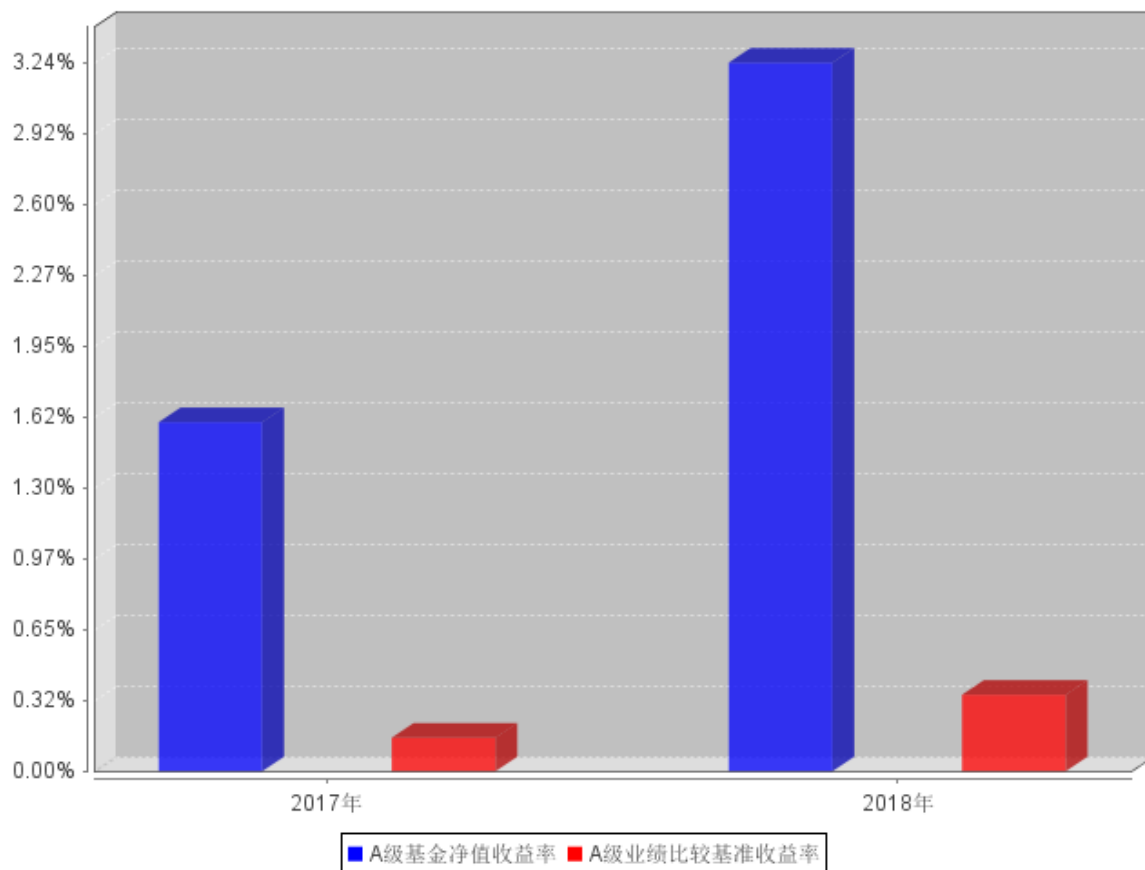


注：1、本基金合同生效日为 2017 年 7 月 25 日。

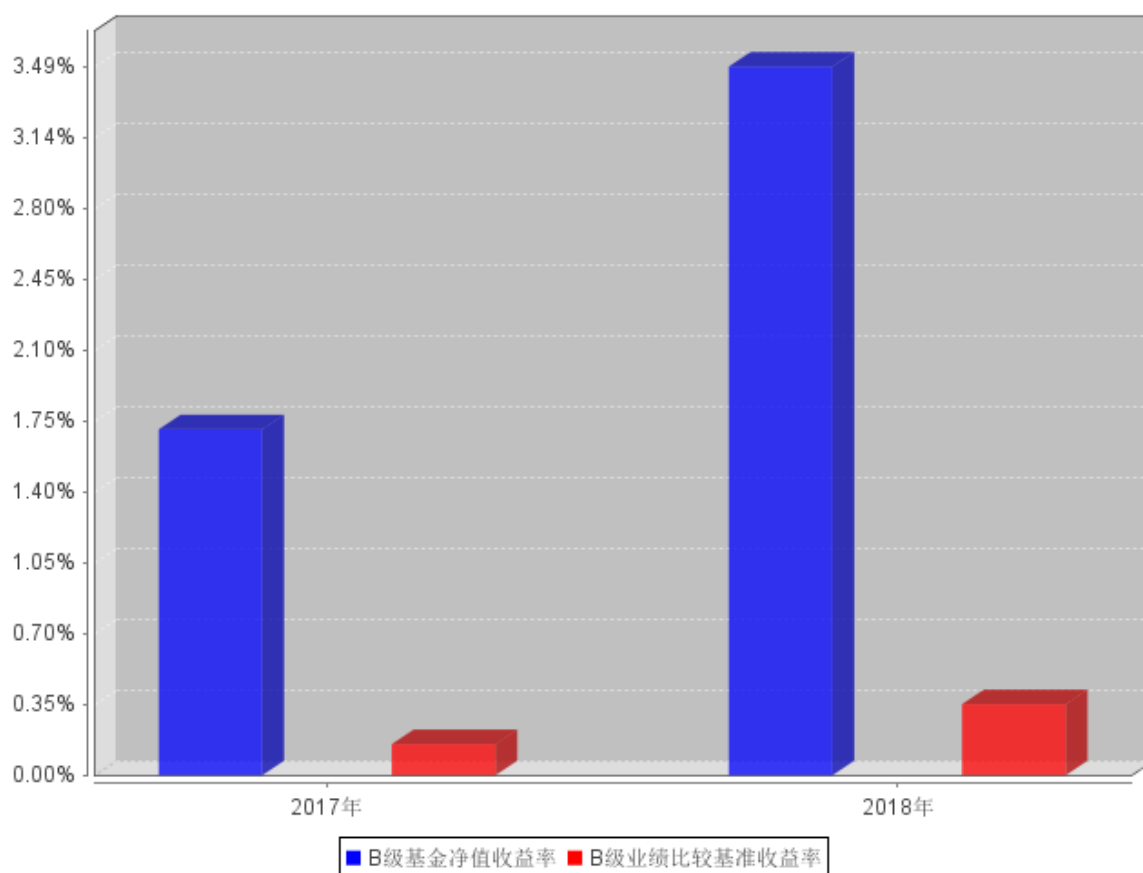
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

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

A级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对比图



B级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对比图



注：本基金合同于 2017 年 7 月 25 日生效，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。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 渤海汇金汇添金货币 A | | | | | |
|-------------|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 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 |
| 2018 | 2,488,192.82 | - | - | 2,488,192.82 | |
| 2017 | 6,694,982.38 | - | - | 6,694,982.38 | |
| 合计 | 9,183,175.20 | - | - | 9,183,175.20 | |

单位：人民币元

| 渤海汇金汇添金货币 B | | | | | |
|-------------|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 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 |
| 2018 | 5,710,526.24 | - | - | 5,710,526.24 | |

| | | | | | |
|------|---------------|---|---|---------------|--|
| 2017 | 6,311,990.79 | - | - | 6,311,990.79 | |
| 合计 | 12,022,517.03 | - | - | 12,022,517.03 | |

§ 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

渤海汇金证券资产管理有限公司（简称渤海汇金、渤海汇金资管）前身为渤海证券资产管理总部，经中国证监会证监许可[2016]3号文批准，成立于2016年5月18日。注册地为深圳，注册资本为11亿元，业务范围为证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务，是渤海证券股份有限公司的全资子公司。

截至2018年12月31日，本基金管理人共管理5只基金：渤海汇金汇添金货币市场基金、渤海汇金汇增利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金汇添益3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金。

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 | | |
| 何翔 | 本基金的基金经理、公募投资总监、公募投资部总经理 | 2017年7月25日 | 2018年12月10日 | 14年 | 南开大学数学学士、金融学硕士。2004年2月至2013年10月就职于渤海证券研究所，任金融工程部经理。2013年10月至2016年8月就职于渤海证券基金管理总部，任投资研究部经理。2016年8月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任公募投资总监。2017年7月至2018年12月10日担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经 |

| | | | | | |
|----|----------|-----------------|------------------|-----|---|
| | | | | | 理。2018 年 2 月起担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2018 年 7 月起担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。 |
| 林思 | 本基金的基金经理 | 2017 年 7 月 25 日 | 2018 年 12 月 10 日 | 7 年 | 南开大学金融工程硕士。2011 年 7 月至 2013 年 10 月就职于渤海证券研究所，任金融工程分析师。2013 年 10 月至 2016 年 8 月就职于渤海证券基金管理总部，任基金经理助理。2016 年 8 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月 10 日担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2018 年 7 月起担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。 |
| 李杨 | 本基金的基金经理 | 2017 年 8 月 7 日 | - | 2 年 | 天津财经大学经济学学士。2011 年 10 月到 2014 年 4 月，在包商银行股份有限公司任债券交易员，2014 年 5 月到 2016 年 8 月，在天津银行股份有限公司任债券交易员，2016 年 9 月至今，在渤海汇金证券资产管理有限公司任基金经理。2017 年 8 月起任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2017 年 12 月起任渤海汇 |

| | | | | | |
|-----|----------|-----------------|---|-----|--|
| | | | | | 金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2017 年 12 月起任渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 2 月起担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。 |
| 鞠诗颖 | 本基金的基金经理 | 2018 年 8 月 21 日 | - | 6 年 | 美国杜克大学管理学硕士。2012 年 6 月至 2017 年 6 月就职于摩根士丹利华鑫证券有限责任公司固定收益部，任债券交易员。2017 年 6 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任基金经理。2018 年 8 月起担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。 |

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金汇添金货币市场基金基金合同》等基金法律文件的约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。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

按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司《渤海汇金证券资产管理有限公司公募业务公平交易制度》，以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现，结合盘中实时监控，事后分析和信息披露等风险控制措施加强对于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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合在获得投资信息、投资建议和实时投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对投资指令进行综合平衡，保证交易在各资产组合间的公平执行，保证各类投资人得到公平对待。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，报告期内，本基金未发生异常交易行为，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交的单边交易量超过该证券交易当日成交量的 5% 的情形。

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 年债券市场在内外因素的共同作用下，走出了一波牛市行情，长短端债券收益均有大幅的下行。10 年国债和 10 年国开收益率分别下行 70bps 和 120bps，1 年国债和 1 年国开收益分别下行 120bps 和 170bps。推动债券市场走牛的原因包含如下几方面因素：首先，国内经济动能切换期，“几碰头”——即全球贸易摩擦造成外需对国内经济带动作用的减弱；地方投融资和金融机行为规范带来短期基建增速下行；信用风险暴露，私人部门投资受影响——加剧了经济下行压力。其次，为对冲经济下行风险，疏通信用传导机制，货币政策由稳健中性转向稳健偏宽松，流动性整体保持合理充裕。再次，权益市场表现低迷加之不断爆出的民企债券违约事件，导致市场风险偏好大幅降低，大量资金涌向利率债品种。

报告期内，基金以同业存单、回购和 AAA 超短融为主要配置资产。在资金面总体宽松的格局

下，把握季末、年末等关键时点的资金结构性紧张行情。时刻关注 AAA 评级银行存单和相同评级短期债券的利差情况，动态调整组合中两类资产的配置比例。组合自成立以来保持了较好的流动性和较稳定的收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期渤海汇金汇添金货币 A 的基金份额净值收益率为 3.2463%，本报告期渤海汇金汇添金货币 B 的基金份额净值收益率为 3.4953%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

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 2019 年，从基本面看，经济增长继续承压。目前投资仍是拉动经济的主要动力。2019 年投资将呈现“两上一下”的格局，基建投资托底的必要性上升；制造业投资继续温和增长；受到棚改监管的限制，房地产投资将会下滑。出口受到中美贸易冲突长期化和全球经济下滑压力，将会出现明显下滑，对中国经济增长的贡献继续减小。消费在目前居民部门高杠杆及收入水平有所下滑的情况下也很难起到拉动经济增长的作用。从政策面看，将会采取更为积极的财政政策，货币政策将由稳健中性转为稳健宽松，维持流动性“合理充裕”。美联储加息路径的放缓也为我国货币政策的独立性留出更大空间，在基本面企稳前，难言转向。从市场情绪看，2019 年宽信用的政策还会逐步发力，效果将会逐渐显现，市场风险偏好将有所修复。

货币政策持续宽松和经济基本面下行压力这两方面因素是推动 2018 年债券市场牛市的主要因素。展望 2019 年我们认为上述因素仍然对债券市场形成支撑。另外，全球经济增速的下行以及联储加息步伐的放慢也给予我们货币政策更大的空间。所以 2019 年债券市场在低利率的环境下仍然存在一定的配置和交易机会。另一方面，经历 2018 年的债券牛市之后，债券的票息保护厚度显著降低，趋势性机会的幅度较 2018 年将大幅减少。此外，若我国稳增长政策显著发力并且伴随信用传导机制疏通，可能会对市场预期产生一定影响，造成利率特别是交易盘活跃的 10 年期利率品种的大幅波动。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性管理。明确合规标准且风险可控的前提下，积极响应业务需求，为业务发展提供合规支持。既保证业务顺利展开，又防范了重大合规风险。在基金营销、投资管理、信息披露以及新

产品设计开发、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务，在投资范围、投资工具、运作规则等方面，重点关注防控风险。同时，加强反洗钱、反恐怖融资和反逃税工作。

为进一步规范公司合规管理工作，将合规管理渗透到公司各部门，建立公司依法经营、合规运作的长效机制，公司修订了《渤海汇金证券资产管理有限公司法律合规部管理办法》、《渤海汇金证券资产管理有限公司合规检查管理规定》、《渤海汇金证券资产管理有限公司合规管理人员职责管理细则》等制度。建立各项业务间风险、合规信息的沟通与共享机制，充分发挥风控合规工作统筹协调的作用，实现在关键业务开展、新规则实施前及突发业务发生时，合规风控明确标准，相关业务部门共同参与讨论，建立更新流程，做到关键业务的风险可控。

同时，完成日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，消除新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险隐患。

此外，我们还积极配合监管机关进行各类统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告及附表。

公司监察稽核工作整体平稳开展，根据监管变化和基金业务开展情况，适时调整工作安排，提高监察稽核工作质量，明确监察稽核各业务环节工作职责，规范稽核工作程序，加强对公司各业务条线、各部门的管理和监督，防范和控制风险，改善公司的经营管理情况。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由投资负责人、研究负责人、产品设计负责人、财务负责人、运营保障负责人、风险控制部和法律合规部负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。公募投资部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中

国证券投资基金业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同约定，本基金的收益分配采取“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为基金份额持有人每日计算当日收益并分配，并每日进行支付。本报告期内应分配收益 8,198,719.06 元，实际分配收益 8,198,719.06 元。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关要求，基金合同生效后，连续二十个工作日出现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情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在渤海汇金汇添金货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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(2019)第 26235 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 | 渤海汇金汇添金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>我们审计了渤海汇金汇添金货币市场基金(以下简称“汇添金货币基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 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,公允反映了汇添金货币基金 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。</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,我们独立于汇添金货币基金,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 | - |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>汇添金货币基金的基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司(以下简称“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汇添金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汇添金货币基金、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汇添金货币基金的财务报告过程。</p> |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <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设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇添金货币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汇添金货币基</p> |

| | | |
|-----------|--|----|
| | <p>金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),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 | 李铁英 | 朱辉 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼 | |
| 审计报告日期 | 2019 年 3 月 22 日 | |

注: 会计师出具了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：渤海汇金汇添金货币市场基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 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 | 7.4.7.1 | 1,043,179.41 | 1,483,185.54 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 660.69 | 302.41 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 278,634,818.55 | 199,449,025.68 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 278,634,818.55 | 199,449,025.68 |
| 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 | 102,501,193.75 | 32,100,163.65 |
| 应收证券清算款 | | - | 5,424.65 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,180,818.01 | 1,324,888.20 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 383,360,670.41 | 234,362,990.13 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 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 | 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 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 77,580.53 | 78,657.82 |
| 应付托管费 | | 25,860.18 | 26,219.28 |
| 应付销售服务费 | | 11,126.88 | 37,682.33 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 19,615.30 | 16,966.26 |
| 应交税费 | | 2,910.10 | - |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 139,000.00 | 159,000.00 |
| 负债合计 | | 276,092.99 | 318,525.69 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 383,084,577.42 | 234,044,464.44 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 383,084,577.42 | 234,044,464.44 |
| 负债和所有者权益总计 | | 383,360,670.41 | 234,362,990.13 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 383,084,577.42 份，其中 A 类基金份额总额 40,277,230.28 份，B 类基金份额总额 342,807,347.14 份。

7.2 利润表

会计主体：渤海汇金汇添金货币市场基金

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 | 附注号 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2017 年 7 月 25 日(基 金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | 9,618,274.52 | 15,219,279.53 |
| 1.利息收入 | | 9,401,520.06 | 14,755,071.06 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 6,427.19 | 5,709,732.36 |
| 债券利息收入 | | 6,686,953.00 | 5,854,994.97 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,708,139.87 | 3,190,343.73 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 216,754.46 | 464,208.47 |
| 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 | 216,754.46 | 464,208.47 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|--------------|---------------|
| 列) | | | |
| 减：二、费用 | | 1,419,555.46 | 2,212,306.36 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 751,195.91 | 1,110,560.83 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 250,398.61 | 370,186.94 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 201,931.69 | 511,280.23 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | - | 45.00 |
| 5. 利息支出 | | 17,035.18 | 28,823.15 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 17,035.18 | 28,823.15 |
| 6. 税金及附加 | | 5,526.39 | - |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.20 | 193,467.68 | 191,410.21 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 8,198,719.06 | 13,006,973.17 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 8,198,719.06 | 13,006,973.17 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金汇添金货币市场基金

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） | 234,044,464.44 | - | 234,044,464.44 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 8,198,719.06 | 8,198,719.06 |
| 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） | 149,040,112.98 | - | 149,040,112.98 |
| 其中：1. 基金申购款 | 733,843,515.90 | - | 733,843,515.90 |
| 2. 基金赎回款 | -584,803,402.92 | - | -584,803,402.92 |
| 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） | - | -8,198,719.06 | -8,198,719.06 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 383,084,577.42 | - | 383,084,577.42 |

| 项目 | 上年度可比期间 2017 年 7 月 25 日(基金合同生效日)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) | 2,332,858,923.00 | - | 2,332,858,923.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 13,006,973.17 | 13,006,973.17 |
| 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) | -2,098,814,458.56 | - | -2,098,814,458.56 |
| 其中：1. 基金申购款 | 253,333,360.51 | - | 253,333,360.51 |
| 2. 基金赎回款 | -2,352,147,819.07 | - | -2,352,147,819.07 |
| 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) | - | -13,006,973.17 | -13,006,973.17 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 234,044,464.44 | - | 234,044,464.44 |

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

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：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>徐海军</u> | <u>周里勇</u> | <u>徐长莹</u> |
| 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

渤海汇金汇添金货币市场基金(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[2017]第 728 号《关于准予渤海汇金汇添金货币市场基金注册的批复》核准，由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金汇添金货币市场基金基金合同》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 2,332,168,995.17 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2017)第 722 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《渤海汇金汇添金货币市场基金基金合同》于 2017 年 7 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,332,858,923.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 689,927.83 份基金份额。本基金的基金

管理人为渤海汇金证券资产管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《渤海汇金汇添金货币市场基金基金合同》和《渤海汇金汇添金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持有本基金的份额数量进行基金份额类别划分。本基金分设 A 类和 B 类两类基金份额，两类基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，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七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金汇添金货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准：人民币活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司于 2019 年 3 月 22 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》、《渤海汇金汇添金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。

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 重要会计政策和会计估计

本期会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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应付管理人报酬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。对于取得债券投资支付的价款中包含的债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偏离度绝对值达到或超过 0.25%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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场, 采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时, 尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。

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, 以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

无。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债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后的净额确认为利息收入。

债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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。当日申购的基金份额自下一个开放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开放日起不享有基金的收益分配权益。本基金每日以红利再投资(即红利转基金份额)方式支付收益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，将基金份额净值维持在份额面值 1.00 元。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 金融资产的估值

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(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)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。基金持有的证券交易所上

市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),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。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(2) 金融负债的估值

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应付管理人报酬和其他各类应付款项等。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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[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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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,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,对存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

(2) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 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。

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 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 1,043,179.41 | 1,483,185.54 |
| 定期存款 | - | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计： | 1,043,179.41 | 1,483,185.54 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2018 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 | 278,634,818.55 | 278,864,000.00 | 229,181.45 | 0.0598% |
| | 合计 | 278,634,818.55 | 278,864,000.00 | 229,181.45 | 0.0598% |
| 项目 | | 上年度末 2017 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 | 999.45 | 998.50 | -0.95 | 0.0000% |
| | 银行间市场 | 199,448,026.23 | 199,277,000.00 | -171,026.23 | -0.0731% |
| | 合计 | 199,449,025.68 | 199,277,998.50 | -171,027.18 | -0.0731% |

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

注：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 2018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 | 102,501,193.75 | - |
| 合计 | 102,501,193.75 | - |
| 项目 | 上年度末 2017年12月31日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 3,000,000.00 | - |
| 买入返售证券_银行间 | 29,100,163.65 | - |
| 合计 | 32,100,163.65 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从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 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|-----------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 197.47 | 524.70 |
| 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 | 1,006,613.71 | 1,282,737.63 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | 174,006.50 | 41,625.76 |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 其他 | 0.33 | 0.11 |
| 合计 | 1,180,818.01 | 1,324,888.20 |

7.4.7.6 其他资产

注：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 2018年12月31日 | 上年度末 2017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 | 19,615.30 | 16,966.26 |
| 合计 | 19,615.30 | 16,966.26 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 预提费用 | 139,000.00 | 159,000.00 |
| 合计 | 139,000.00 | 159,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 渤海汇金汇添金货币 A | | |
|---------------|-----------------------------|-----------------|
| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 150,928,064.50 | 150,928,064.50 |
| 本期申购 | 62,437,408.64 | 62,437,408.64 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -173,088,242.86 | -173,088,242.86 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 40,277,230.28 | 40,277,230.28 |

金额单位：人民币元

| 渤海汇金汇添金货币 B | | |
|---------------|-----------------------------|-----------------|
| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 83,116,399.94 | 83,116,399.94 |
| 本期申购 | 671,406,107.26 | 671,406,107.26 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -411,715,160.06 | -411,715,160.06 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 342,807,347.14 | 342,807,347.14 |

注：申购含红利再投、转换入份额以及 A 类基金份额与 B 类基金份额之间自动升降级而增减的基金份额；赎回含转换出份额以及 A 类基金份额与 B 类基金份额之间自动升降级而增减的基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 渤海汇金汇添金货币 A | | | |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 项目 | 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 | 2,488,192.82 | - | 2,488,192.82 |
| 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 | -2,488,192.82 | - | -2,488,192.82 |
| 本期末 | - | - | - |

单位：人民币元

| 渤海汇金汇添金货币 B | | | |
|-------------|--------------|-------|--------------|
| 项目 | 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 | 5,710,526.24 | - | 5,710,526.24 |

| | | | |
|----------------|---------------|---|---------------|
| 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 | -5,710,526.24 | - | -5,710,526.24 |
| 本期末 | - | - | - |

7.4.7.11 存款利息收入

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7月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|--|
| 活期存款利息收入 | 6,285.84 | 327,912.46 |
| 定期存款利息收入 | - | 5,377,152.79 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 128.35 | 2,749.10 |
| 其他 | 13.00 | 1,918.01 |
| 合计 | 6,427.19 | 5,709,732.36 |

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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7月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
|-------------------------------|-----------------------------|--|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 216,754.46 | 464,208.47 |
| 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 | 216,754.46 | 464,208.47 |

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018 年12月31日 | 上年度可比期间 2017年7月25日(基金合 同生效日)至2017年12月31 日 |
|-----------------------------|---------------------------------|--|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额 | 1,008,260,274.76 | 1,688,319,722.09 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额 | 1,003,332,031.08 | 1,675,739,477.44 |
| 减：应收利息总额 | 4,711,489.22 | 12,116,036.18 |
| 买卖债券差价收入 | 216,754.46 | 464,208.47 |

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无公允价值变动损益。

7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

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7月25日(基金合同生 效日)至2017年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--|
| 交易所市场交易费用 | - | - |
| 银行间市场交易费用 | - | 45.00 |
| 合计 | - | 45.00 |

7.4.7.20 其他费用

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7月25日(基金合同生 效日)至2017年12月31日 |
|----------|---------------------------------|--|
| 审计费用 | 30,000.00 | 100,000.00 |
| 信息披露费 | 100,000.00 | 50,000.00 |
| 银行汇划费用 | 27,467.68 | 29,010.21 |
| 银行间账户维护费 | 36,000.00 | 12,000.00 |
| 其他费用 | - | 400.00 |
| 合计 | 193,467.68 | 191,410.21 |

7.4.7.21 分部报告

无。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告报出日，本基金无需说明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 |
|--------------------------|---------------------|
| 渤海汇金证券资产管理有限公司（“渤海汇金资管”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 渤海证券股份有限公司（“渤海证券”） | 基金管理人的独资股东、基金销售机构 |

注：1、本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、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

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | | 上年度可比期间 2017年7月25日(基金合同生效日)至 2017年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------|--|----------------------|
| | 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 成交总额的 比例 |
| 渤海证券 | 2,678,000.00 | 100.00% | 51,898,886.02 | 100.00% |

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | | 上年度可比期间 2017年7月25日(基金合同生效日)至 2017年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------------|--|----------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 |
| 渤海证券 | 12,000,000.00 | 100.00% | 369,800,000.00 | 100.00% |

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | | | |
|-------|--|----------------|--------------|------------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量 的比例 | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金总 额的比例 |
| 渤海证券 | 267.72 | 100.00% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年7月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量 的比例 | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金总 额的比例 |
| 渤海证券 | 5,352.40 | 100.00% | - | - |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

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 2018年1月1日至2018年12月 31日 | 上年度可比期间 2017年7月25日(基金合同生效 日)至2017年12月31日 |
|---------------------|---------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付 的管理费 | 751,195.91 | 1,110,560.83 |
| 其中：支付销售机构的 客户维护费 | 265,133.30 | 866,610.35 |

注：支付基金管理人渤海汇金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3%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×0.3%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|--|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 7 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 250,398.61 | 370,186.94 |

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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 | | |
|----------------|--|-------------|------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 渤海汇金汇添金货币 A | 渤海汇金汇添金货币 B | 合计 |
| 渤海汇金资管 | 184,262.30 | 17,669.39 | 201,931.69 |
| 合计 | 184,262.30 | 17,669.39 | 201,931.69 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2017 年 7 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 渤海汇金汇添金货币 A | 渤海汇金汇添金货币 B | 合计 |
| 渤海汇金资管 | 494,022.55 | 17,257.68 | 511,280.23 |
| 合计 | 494,022.55 | 17,257.68 | 511,280.23 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给渤海汇金，再由渤海汇金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%和 0.01%。其计算公式为：日销售服务费=前一日 A/B 类基金资产净值×约定年费率/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

单位：人民币元

| 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | | | | | | |
|---|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易 的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国银行 | 90,005,526.59 | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2017 年 7 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 | | | | | | |
| 银行间市场交易 的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |

注：本基金上年度可比期间内未发生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

份额单位：份

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | |
|---------------------------------|--|---------------|
| | 渤海汇金汇添金货币 A | 渤海汇金汇添金货币 B |
| 基金合同生效日（2017 年 7 月 25 日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | 20,004,098.39 |
| 期间申购/买入总份额 | - | 587,878.41 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | 5,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额 | - | 15,591,976.80 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 4.55% |

| 项目 | 上年度可比期间 2017 年 7 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 | |
|---------------------------------|---|---------------|
| | 渤海汇金汇添金货币 A | 渤海汇金汇添金货币 B |
| 基金合同生效日（2017 年 7 月 25 日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | 20,004,098.39 |

| | | |
|-----------------------|---|---------------|
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | - | 20,004,098.39 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | - | 24.07% |

注：本基金不收取申购费用和赎回费用。

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

注：本基金本报告期末及上年度可比期间期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金 A 类及 B 类基金份额的情况。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2017 年 7 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 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 |
| 中国银行 | 1,043,179.41 | 6,285.84 | 1,483,185.54 | 1,150,690.24 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

渤海汇金汇添金货币A

| 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 |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 2,488,192.82 | - | - | 2,488,192.82 | - |

渤海汇金汇添金货币B

| 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 |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 5,710,526.24 | - | - | 5,710,526.24 | - |

7.4.12 期末（2018 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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而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

注：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从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金投资的金融工具主要为各类货币市场工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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，以实现在保证本金安全和资产流动性最大化的前提下，追求超过业绩比较基准的收益的投资目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立以董事会为风险管理的最高决策机构，以经营层负责风险管理主体责任，以首席风险官负责风险管理工作具体推动落实，以风险管理委员会为风险管理工作指导机构，由专职的风险控制部门为风险管理的督导执行部门，由管理、支持与保障部门及业务部门、各分支机构为风险管理的具体落实部门的多层级的全面风险管理体系。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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，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，不投资于信用评级在 AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具，且通过分散化投资以分散信用风险。

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 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 30,014,811.13 | 60,036,150.16 |
| 合计 | 30,014,811.13 | 60,036,150.16 |

注：未评级债券为未有第三方评级的短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

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 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 228,577,962.84 | 119,418,835.39 |
| 合计 | 228,577,962.84 | 119,418,835.39 |

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 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 20,042,044.58 | 19,994,040.13 |
| 合计 | 20,042,044.58 | 19,994,040.13 |

注：未评级债券为政策性金融债等免评级债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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。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占基金资产净值的比例不得超过 20%。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

7.4.13.4 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。

本基金主要投资于交易所以及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 2018 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 | 1,043,179.41 | - | - | - | - | 1,043,179.41 |
| 存出保证金 | 660.69 | - | - | - | - | 660.69 |
| 交易性金融资产 | 278,634,818.55 | - | - | - | - | 278,634,818.55 |
| 买入返售金融资产 | 102,501,193.75 | - | - | - | - | 102,501,193.75 |
| 应收利息 | - | - | - | - | -1,180,818.01 | 1,180,818.01 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 382,179,852.40 | - | - | - | -1,180,818.01 | 383,360,670.41 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 77,580.53 | 77,580.53 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 25,860.18 | 25,860.18 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 11,126.88 | 11,126.88 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 19,615.30 | 19,615.30 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 2,910.10 | 2,910.10 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 139,000.00 | 139,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 276,092.99 | 276,092.99 |
| 利率敏感度缺口 | 382,179,852.40 | - | - | - | 904,725.02 | 383,084,577.42 |
| 上年度末 2017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 | 1,483,185.54 | - | - | - | - | 1,483,185.54 |
| 存出保证金 | 302.41 | - | - | - | - | 302.41 |
| 交易性金融资产 | 179,432,652.31 | 20,016,373.37 | - | - | - | 199,449,025.68 |
| 买入返售金融资产 | 32,100,163.65 | - | - | - | - | 32,100,163.65 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | 5,424.65 | 5,424.65 |
| 应收利息 | - | - | - | - | -1,324,888.20 | 1,324,888.20 |
| 资产总计 | 213,016,303.91 | 20,016,373.37 | - | - | -1,330,312.85 | 234,362,990.13 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 78,657.82 | 78,657.82 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 26,219.28 | 26,219.28 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 37,682.33 | 37,682.33 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 16,966.26 | 16,966.26 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 159,000.00 | 159,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 318,525.69 | 318,525.69 |
| 利率敏感度缺口 | 213,016,303.91 | 20,016,373.37 | - | - | -1,011,787.16 | 234,044,464.44 |

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（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2018年12月31日） | 上年度末（2017年12月31日） |
| | 市场利率上升 25 个基点 | 12.52 | -1.65 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | -12.51 | 1.66 |

注：单位：万元

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。本基金主要投资于交易所以及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。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

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 2018 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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为人民币 278,634,818.55 元，无属于第三层次的余额（于 2017 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一层次的余额为人民币 999.45 元，属于第二层次的余额为人民币 199,448,026.23 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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 2018 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。

(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) 除公允价值外，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 | 278,634,818.55 | 72.68 |
| | 其中: 债券 | 278,634,818.55 | 72.68 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 102,501,193.75 | 26.74 |
| | 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 | 1,043,179.41 | 0.27 |
| 4 | 其他各项资产 | 1,181,478.70 | 0.31 |
| 5 | 合计 | 383,360,670.41 | 100.00 |

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 0.32 | |
| | 其中: 买断式回购融资 | - | |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中: 买断式回购融资 | - | - |

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

| 序号 | 发生日期 | 融资余额占基金资产净值比例 (%) | 原因 | 调整期 |
|----|------------------|-------------------|------|--------|
| 1 | 2018 年 11 月 26 日 | 24.39 | 巨额赎回 | 1 个交易日 |

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 | 52 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 64 |
| 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

注：本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过 120 天的情况。

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 | 34.85 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 15.59 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 46.72 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—120 天 | 2.61 | - |
| | 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 | 99.76 | - |

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

注：本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

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 (%) |
|----|----------------------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 20,042,044.58 | 5.23 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,042,044.58 | 5.23 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,014,811.13 | 7.84 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 228,577,962.84 | 59.67 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 278,634,818.55 | 72.73 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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 | 111806216 | 18 交通银行 CD216 | 300,000 | 29,774,361.26 | 7.77 |
| 2 | 111892516 | 18 南京银行 CD031 | 200,000 | 19,899,065.84 | 5.19 |
| 3 | 111809427 | 18 浦发银行 CD427 | 200,000 | 19,829,494.99 | 5.18 |
| 4 | 180404 | 18 农发 04 | 100,000 | 10,028,406.55 | 2.62 |
| 5 | 011801385 | 18 融和融资 SCP007 | 100,000 | 10,013,854.09 | 2.61 |
| 6 | 180201 | 18 国开 01 | 100,000 | 10,013,638.03 | 2.61 |
| 7 | 011801495 | 18 杭金投 SCP007 | 100,000 | 10,000,546.32 | 2.61 |
| 8 | 011802563 | 18 冀中能源 SCP020 | 100,000 | 10,000,410.72 | 2.61 |
| 9 | 111887781 | 18 宁波银行 CD210 | 100,000 | 9,975,636.26 | 2.60 |
| 10 | 111891096 | 18 杭州银行 CD003 | 100,000 | 9,974,875.59 | 2.60 |

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 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1673% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.1028% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0659% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金报告期内无此情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金报告期内无此情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金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

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值维持在 1.0000 元。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

无

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 | 660.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 1,180,818.01 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,181,478.70 |

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有尾差。

§ 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 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 |
| 渤海 汇金 汇添 金货 币 A | 3,420 | 11,776.97 | 6,929,937.70 | 17.21% | 33,347,292.58 | 82.79% |
| 渤海 汇金 汇添 金货 币 B | 18 | 19,044,852.62 | 342,807,347.14 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 3,438 | 111,426.58 | 349,737,284.84 | 91.30% | 33,347,292.58 | 8.70% |

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 | 券商类机构 | 40,070,444.03 | 10.46% |
| 2 | 券商类机构 | 30,438,646.89 | 7.95% |
| 3 | 券商类机构 | 30,019,292.45 | 7.84% |
| 4 | 券商类机构 | 24,733,199.59 | 6.46% |
| 5 | 信托类机构 | 20,653,598.51 | 5.39% |
| 6 | 券商类机构 | 20,378,442.01 | 5.32% |
| 7 | 券商类机构 | 20,215,483.32 | 5.28% |
| 8 | 券商类机构 | 20,056,051.81 | 5.24% |
| 9 | 券商类机构 | 20,037,857.43 | 5.23% |
| 10 | 基金类机构 | 20,012,861.62 | 5.22% |

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（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 | 渤海汇金汇添金货币 A | 364,154.76 | 0.0951% |
| | 渤海汇金汇添金货币 B | - | - |
| | 合计 | 364,154.76 | 0.0951% |

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的情况

| 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 | 渤海汇金汇添金货币 A | 10~50 |
| | 渤海汇金汇添金货币 B | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 渤海汇金汇添金货币 A | 0~10 |
| | 渤海汇金汇添金货币 B | 0 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 渤海汇金汇添金 货币 A | 渤海汇金汇添金 货币 B |
|------------------------------------|------------------|-----------------|
| 基金合同生效日（2017 年 7 月 25 日）基金 份额总额 | 1,358,759,940.22 | 974,098,982.78 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 150,928,064.50 | 83,116,399.94 |
| 本报告期基金总申购份额 | 62,437,408.64 | 671,406,107.26 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 173,088,242.86 | 411,715,160.06 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 40,277,230.28 | 342,807,347.14 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

本基金基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于 2018 年 7 月 25 日发布公告，自 2018 年 7 月 23 日起，渤海汇金证券资产管理有限公司的董事会秘书由李唤工先生变更为周里勇先生。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本基金基金托管人重大人事变动：

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，管理人与前员工发生劳动争议民事诉讼，对基金份额持有人利益无任何不利影响。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 30,000.00 元。截至本报告期末，该审计机构已为本基金提供审计服务 1 年 5 个月。

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

本报告期内，未发生基金管理人、托管人及高级管理人员受到稽查或者处罚情况。

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 | |
| 渤海证券 | 2 | - | - | 267.72 | 100.00% | - |

注：1、本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计。

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准：券商经营行为规范；具有较强的研究服务能力，包括研究及投资建议质量、报告的及时性和服务质量；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格；本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

4、本基金本报告期内无新增券商交易单元。

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 | |
|------|--------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
| | 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 |
| 渤海证券 | 2,678,000.00 | 100.00% | 12,000,000.00 | 100.00% | - | - |

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金报告期内无此情况。

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 | 渤海汇金汇添金货币基金 2017 年 4 季度管理报告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 1 月 19 日 |
| 2 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2018 年春节前暂停申购业务的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 2 月 13 日 |
| 3 | 渤海汇金汇添金货币市场基金恢复申购业务的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 2 月 22 日 |
| 4 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于渤海汇金汇添金货币市场基金修订基金合同、托管协议等法律文件的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 5 日 |
| 5 | 渤海汇金汇添金货币市场基金基金合同（2018 年 2 月修订） | 公司网站 | 2018 年 3 月 5 日 |
| 6 | 渤海汇金汇添金货币市场基金托管协议（2018 年 2 月修订） | 公司网站 | 2018 年 3 月 5 日 |
| 7 | 渤海汇金汇添金货币市场基金招募说明书(更新)（2018 年第 1 号） | 公司网站 | 2018 年 3 月 9 日 |
| 8 | 渤海汇金汇添金货币市场基金招募说明书(更新)摘要（2018 年第 1 号） | 证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 9 日 |
| 9 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加天天基金网、好买网费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 14 日 |
| 10 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2017 年度报告 | 公司网站 | 2018 年 3 月 30 日 |
| 11 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2017 年度报告摘要 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 3 月 30 日 |
| 12 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2018 年第 1 季度报告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 4 月 19 日 |
| 13 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加上海基煜基金销售有限公司优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 4 月 26 日 |
| 14 | 关于渤海汇金证券资产管理有限公司增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 4 月 26 日 |
| 15 | 关于渤海汇金证券资产管理有限公司增加天津国美基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 5 月 25 日 |
| 16 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加天津国美基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 5 月 25 日 |

| | | | |
|----|---|-----------|------------|
| 17 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加东海证券股份有限公司费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018年6月5日 |
| 18 | 关于渤海汇金证券资产管理有限公司增加东海证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018年6月5日 |
| 19 | 渤海汇金汇添金货币市场基金2018年第2季度报告 | 证券时报、公司网站 | 2018年7月20日 |
| 20 | 2018年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员(董事会秘书)变更公告 | 证券时报、公司网站 | 2018年7月25日 |
| 21 | 关于旗下部分基金增加北京恒宇天泽基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018年8月17日 |
| 22 | 关于旗下部分基金增加民商基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 公司网站 | 2018年8月22日 |
| 23 | 渤海汇金汇添金货币市场基金增聘基金经理公告 | 证券时报、公司网站 | 2018年8月23日 |
| 24 | 关于旗下部分基金增加民商基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 证券时报 | 2018年8月24日 |
| 25 | 渤海汇金汇添金货币市场基金2018年半年度报告 | 公司网站 | 2018年8月29日 |
| 26 | 渤海汇金汇添金货币市场基金2018年半年度报告摘要 | 证券时报、公司网站 | 2018年8月29日 |
| 27 | 关于旗下部分基金增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018年8月31日 |
| 28 | 关于旗下部分基金增加中信建投证券股份有限公司为代销机构的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018年8月31日 |
| 29 | 渤海汇金汇添金货币市场基金招募说明书(更新)(2018年第2号) | 公司网站 | 2018年9月7日 |
| 30 | 渤海汇金汇添金货币市场基金招募说明书(更新)摘要(2018年第2号) | 证券时报、公司网站 | 2018年9月7日 |
| 31 | 关于旗下部分基金增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的 | 证券时报、公司网站 | 2018年9月14日 |

| | | | |
|----|---|-----------|------------------|
| | 公告 | | |
| 32 | 关于旗下部分基金增加信达证券股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 9 月 14 日 |
| 33 | 关于旗下部分基金增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 10 月 23 日 |
| 34 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2018 年第 3 季度报告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 10 月 25 日 |
| 35 | 关于旗下部分基金增加嘉实财富管理有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 10 月 26 日 |
| 36 | 关于旗下部分基金增加深圳前海财厚基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 12 月 5 日 |
| 37 | 渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理变更公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 12 月 12 日 |
| 38 | 关于旗下部分基金增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2018 年 12 月 20 日 |

§ 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 | 20180424-20180611 | 0.00 | 50,292,480.34 | 50,292,480.34 | 0.00 | 0.00% |
| | 2 | 20180612-20180625 20181107-20181125 | 0.00 | 55,758,061.79 | 55,758,061.79 | 0.00 | 0.00% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

报告期内，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。由此可能导致的特有风险主要包括：

1. 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响。
2. 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个或 2 个以上开放日发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项，对剩余投资者的赎回办理造成影响。
3. 单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金报告期内，根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，对本基金基金合同、托管协议等法律文件进行修订，具体信息请参见基金管理人于 2018 年 3 月 5 日披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于渤海汇金汇添金货币市场基金修订基金合同、托管协议等法律文件的公告》及相应更新后的基金法律文件。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金汇添金货币市场基金设立的文件；
- 2、《渤海汇金汇添金货币市场基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金汇添金货币市场基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金汇添金货币市场基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、渤海汇金汇添金货币市场基金在指定报刊上的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

13.3 查阅方式

上述文件可在渤海汇金证券资产管理有限公司网站上查阅，或者在营业时间内到渤海汇金证券资产管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-5988/400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

渤海汇金证券资产管理有限公司

2019年3月28日