

# 渤海汇金汇添金货币市场基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 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

报告送出日期:2024 年 08 月 31 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2024年08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2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 债券回购融资情况	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限	38
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	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	39
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	39
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	40
7.9 投资组合报告附注	40
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
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 .....	42
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4 基金投资策略的改变 .....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	44
10.9 其他重大事件 .....	44
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</b>
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 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录 .....	47
12.2 存放地点 .....	47
12.3 查阅方式 .....	47

## § 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	渤海汇添金货币基金			
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 07 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	2,665,554,493.02 份			
基金合同存续期	-			
下属分级基金的基金简称	汇添金货币 A	汇添金货币 B	汇添金货币 C	汇添金货币 D
下属分级基金的交易代码	004786	004787	019634	019635
报告期末下属分级基金的份额总额	91,818,111.04 份	2,558,695,666.60 份	0.00 份	15,040,715.38 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</p>

	<p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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。

## 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	吴国威
	联系电话	022-23861655
	电子邮箱	liujia@bhhjamc.com
客户服务电话	400-651-1717	95566
传真	022-23861651	010-66594942
注册地址	深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号基金小镇对冲基金中心 506	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号基金小镇对冲基金中心 506	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	100818
法定代表人	齐朝晖	葛海蛟

## 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	https://www.bhhjamc.com
基金中期报告备置地点	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
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（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）			
	汇添金货币 A	汇添金货币 B	汇添金货币 C	汇添金货币 D
本期已实现收益	780,443.15	23,168,771.22	-	39,714.79
本期利润	780,443.15	23,168,771.22	-	39,714.79
本期净值收益率	0.8733%	0.9940%	-	0.9942%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）			
期末基金资产净值	91,818,111.04	2,558,695,666.60	-	15,040,715.38
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（2024 年 06 月 30 日）			
累计净值收益率	16.0102%	17.8836%	-	1.4217%

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、本货币市场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

##### 汇添金货币 A 净值表现

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	0.1181%	0.0012%	0.0288%	0.0000%	0.0893%	0.0012%

过去三个月	0.3920%	0.0018%	0.0873%	0.0000%	0.3047%	0.0018%
过去六个月	0.8733%	0.0019%	0.1745%	0.0000%	0.6988%	0.0019%
过去一年	1.9204%	0.0021%	0.3510%	0.0000%	1.5694%	0.0021%
过去三年	5.7151%	0.0019%	1.0510%	0.0000%	4.6641%	0.0019%
自基金合同生效起至今	16.0102%	0.0027%	2.4289%	0.0000%	13.5813%	0.0027%

#### 汇添金货币 B 净值表现

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	0.1378%	0.0012%	0.0288%	0.0000%	0.1090%	0.0012%
过去三个月	0.4519%	0.0018%	0.0873%	0.0000%	0.3646%	0.0018%
过去六个月	0.9940%	0.0019%	0.1745%	0.0000%	0.8195%	0.0019%
过去一年	2.1653%	0.0021%	0.3510%	0.0000%	1.8143%	0.0021%
过去三年	6.4800%	0.0019%	1.0510%	0.0000%	5.4290%	0.0019%
自基金合同生效起至今	17.8836%	0.0027%	2.4289%	0.0000%	15.4547%	0.0027%

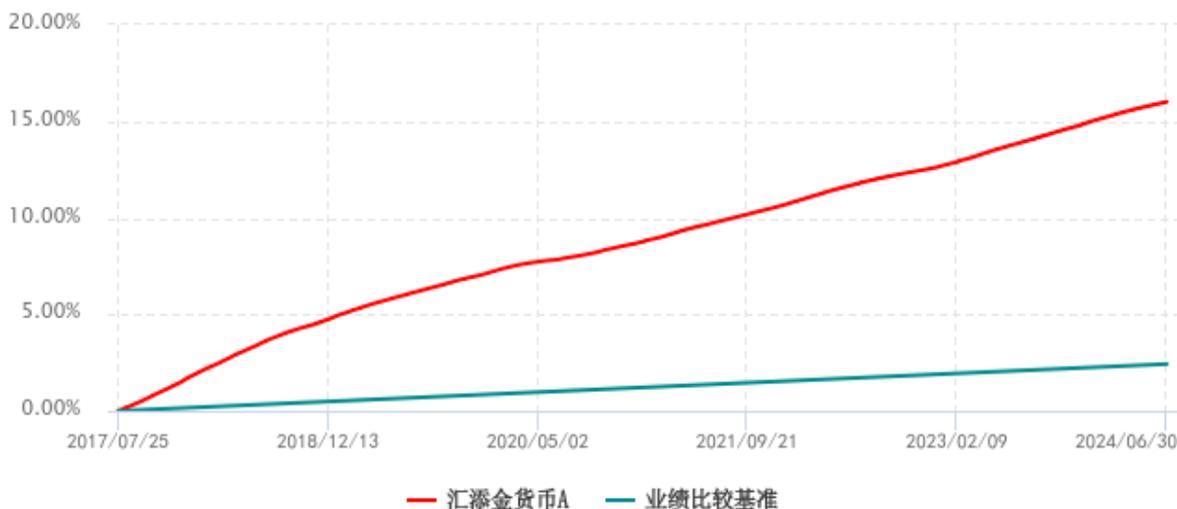
#### 汇添金货币 D 净值表现

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	0.1378%	0.0012%	0.0288%	0.0000%	0.1090%	0.0012%
过去三个月	0.4511%	0.0018%	0.0873%	0.0000%	0.3638%	0.0018%
过去六个月	0.9942%	0.0019%	0.1745%	0.0000%	0.8197%	0.0019%
自基金合同生效起至今	1.4217%	0.0021%	0.2407%	0.0000%	1.1810%	0.0021%

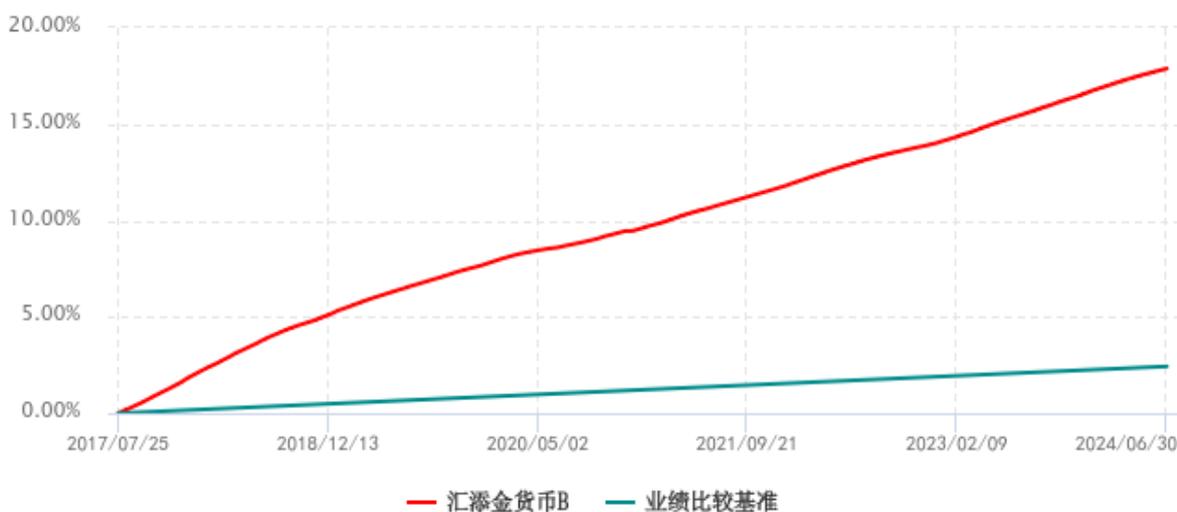
注：业绩比较基准：活期存款利率（税后）。本基金定位为现金管理工具，注重基金资产的流动性和安全性，因此采用活期存款利率（税后）作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布，如果活期存款利率或利息税发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

### 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

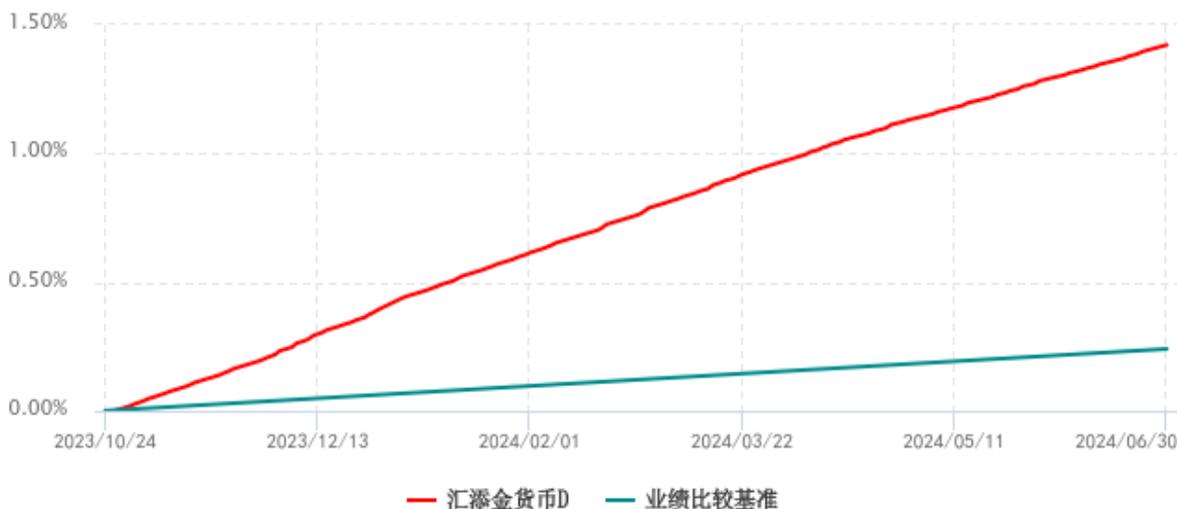
汇添金货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年07月25日-2024年06月30日)



汇添金货币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  
(2017年07月25日-2024年06月30日)



汇添金货币D累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年10月24日-2024年06月30日)



注：1、本基金合同于 2017 年 7 月 25 日生效。

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、经与托管人协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2023 年 10 月 9 日起增设 C 类和 D 类基金份额。其中 D 类份额自首笔份额登记日（即 2023 年 10 月 24 日）起披露业绩数据，C 类份额尚无份额登记。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 17 只公募基金：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、渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金、渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金、渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金、渤

海汇金兴宸一年定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金、渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、渤海汇金优选进取 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、渤海汇金优选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金、渤海汇金 2 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金。

#### 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		
周珂	公募固收部固收投资副总监，本基金基金经理	2021-02-23	-	4 年	北京大学硕士研究生学历，自从业以来一直从事固收投资管理工作。2008 年 7 月至 2014 年 11 月就职于中国投融资担保股份有限公司，担任固收投资经理。2014 年 11 月至 2017 年 4 月就职于昆仑银行股份有限公司，担任固收投资经理。2017 年 4 月至 2019 年 7 月就职于中信保诚人寿保险有限公司，担任固收投资经理岗位。2019 年 8 月至 2020 年 8 月就职于和谐健康保险股份有限公司资产管理部，担任固收投资负责人。2020 年 9 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司，现任公募固收部固收投资副总监，负责公募产品投资管理相关工作，2021 年 1 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，2021 年 2 月起任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2022 年 11 月起任渤海汇金 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。

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、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

### 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、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对指令进行综合平衡，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，并通过恒生 O32 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

#### 4.3.2 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竞价同日反向交易不存在成交较少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

上半年，资金面整体较为平稳宽松，债券收益率整体呈下行态势，特别是超长债的收益率在一季度连创历史新低。上半年地产修复较为缓慢，房地产开发投资和新建商品房销售面积均有不同程度下降。3 月全国制造业 PMI 为 50.8%，较上月回升 1.7 个百分点，为去年 10 月以来首次重返荣枯线上，制造业景气度有所扩张。央行公开市场操作保持弹性，在月中月末和节前及时加大投放，维护流动性合理充裕，3 月开始缩量投放；2 月 5 日起，下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点。二季度受到限制手工补息的影响下，非银资金较为充裕，资金面分层在四、五月份阶段性并未显现；随着理财逐步回表，叠加 6 月缴税及跨季扰动，资金面分层现象重现，跨季期间央行总体适度加大公开市场操作投放使得跨季资金面平稳运行。上半年，银行间市场质押式回购利率 R001、

R007、DR001、DR007 平均值分别为：1.84%、2.03%、1.74%、1.87%。上半年商业银行 AAA 等级同业存单利率水平整体下行，1 月、3 月、6 月、1 年期的 AAA 等级银行同业存单的平均值为 2.01%、2.09%、2.13%、2.21%；半年末比上年末分别下降 0BP、34BP、51BP、48BP。

报告期内，本基金以利率债、同业存单等优质资产为主要投资标的，合理安排账户流动性需求，在根据客户类型和结构匹配相应资产的基础上，通过合理配置资产类型和久期提升基金业绩回报。灵活调整持仓各类资产的比例，控制整体组合资产偏离度，提升基金收益水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇添金货币 A 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.8733%，同期业绩比较基准收益率为 0.1745%；截至报告期末汇添金货币 B 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.9940%，同期业绩比较基准收益率为 0.1745%；截至报告期末汇添金货币 D 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.9942%，同期业绩比较基准收益率为 0.1745%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年市场重点关注经济基本面边际变化、政策落地后效果以及联储降息周期的开启。资金面预计波动幅度不大，整体基调还是低利率环境下的窄幅波动。本基金将合理安排账户流动性需求，在根据客户类型和结构匹配相应资产的基础上，灵活调整持仓各类资产的比例，控制整体组合资产偏离度，提升基金收益水平。

#### 4.6 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委员会，估值委员会成员由公司总经理、分管投资部门的高级管理人员、公募投资部门负责人、财务负责人、产品部及研究部负责人等人组成，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，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 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 23,988,929.16 元,实际分配收益 23,988,929.16 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

报告期内,本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 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:2024 年 06 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产:			
货币资金	6.4.7.1	137,325,014.99	101,572,523.37

结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,626,501,590.84	1,809,467,979.58
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,626,501,590.84	1,809,467,979.58
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	857,772,013.06	968,791,877.34
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		44,970,000.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,666,568,618.89	2,879,832,380.29
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产 款		-	100,009,800.51
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		594,447.96	524,679.55
应付托管费		198,149.35	174,893.21
应付销售服务费		37,733.92	41,723.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		33,243.61	75,057.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	150,551.03	205,471.70
负债合计		1,014,125.87	101,031,625.08
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	2,665,554,493.02	2,778,800,755.21
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		2,665,554,493.02	2,778,800,755.21
负债和净资产总计		2,666,568,618.89	2,879,832,380.29

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,665,554,493.02 份。其中汇添金货币 A 基金

份额净值 1.0000 元，基金份额总额 91,818,111.04 份；汇添金货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,558,695,666.60 份；汇添金货币 C 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 0.00 份；汇添金货币 D 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 15,040,715.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：渤海汇金汇添金货币市场基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		29,341,154.63	15,621,623.55
1. 利息收入		8,498,103.33	4,424,151.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	420,408.67	2,563.13
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		8,077,694.66	4,421,588.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,843,051.30	11,197,471.96
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	20,843,051.30	11,197,471.96
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		5,352,225.47	2,588,324.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,637,150.71	1,717,314.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,212,383.62	572,438.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	228,483.77	126,568.56
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		113,647.55	38,625.20
其中：卖出回购金融资产支出		113,647.55	38,625.20

6. 信用减值损失	6. 4. 7. 19	-	-
7. 税金及附加		34, 144. 64	19, 431. 57
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	126, 415. 18	113, 946. 25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23, 988, 929. 16	13, 033, 298. 85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23, 988, 929. 16	13, 033, 298. 85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		23, 988, 929. 16	13, 033, 298. 85

### 6.3 净资产变动表

会计主体：渤海汇金汇添金货币市场基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2, 778, 800, 755. 21	-	2, 778, 800, 755. 21
二、本期期初净资产	2, 778, 800, 755. 21	-	2, 778, 800, 755. 21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-113, 246, 262. 19	-	-113, 246, 262. 19
（一）、综合收益总额	-	23, 988, 929. 16	23, 988, 929. 16
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-113, 246, 262. 19	-	-113, 246, 262. 19
其中：1. 基金申购款	8, 981, 078, 078. 50	-	8, 981, 078, 078. 50
2. 基金赎回款	-	-	-
	9, 094, 324, 340. 69		9, 094, 324, 340. 69
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-23, 988, 929. 16	-23, 988, 929. 16
四、本期期末净资产	2, 665, 554, 493. 02	-	2, 665, 554, 493. 02
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1, 062, 448, 643. 62	-	1, 062, 448, 643. 62
二、本期期初净资产	1, 062, 448, 643. 62	-	1, 062, 448, 643. 62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	603, 069, 011. 93	-	603, 069, 011. 93
（一）、综合收益总额	-	13, 033, 298. 85	13, 033, 298. 85
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	603, 069, 011. 93	-	603, 069, 011. 93

其中：1. 基金申购款	3,837,657,967.37	-	3,837,657,967.37
2. 基金赎回款	-	-	-
	3,234,588,955.44		3,234,588,955.44
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-13,033,298.85	-13,033,298.85
四、本期期末净资产	1,665,517,655.55	-	1,665,517,655.55

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 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

吴国威	边燕萍	刘云鹏
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

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,已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(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,2023 年 10 月 9 日起,在本基金现有基金份额的基础上增加 C 类基金份额和 D 类基金份额,各类基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,各类基金份额单独设置基金代码,并分别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为：人民币活期存款利率(税后)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人作为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(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，暂不缴纳企业所得税。

(3) 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	137,325,014.99
等于：本金	137,265,527.99
加：应计利息	59,487.00
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	137,325,014.99

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	1,626,501,590.84	1,628,306,904.11	1,805,313.27	0.0677
	合计	1,626,501,590.84	1,628,306,904.11	1,805,313.27	0.0677

资产支持证券	-	-	-	-
合计	1,626,501,590.84	1,628,306,904.11	1,805,313.27	0.0677

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。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：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 2024 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	13,503,772.60	-
银行间市场	844,268,240.46	-
合计	857,772,013.06	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

注：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 2024 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	76,606.45
其中：交易所市场	-
银行间市场	76,606.45
应付利息	-
预提费用	73,944.58
合计	150,551.03

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 汇添金货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	114,368,562.37	114,368,562.37
本期申购	280,715,226.70	280,715,226.70
本期赎回（以“-”号填列）	-303,265,678.03	-303,265,678.03
本期末	91,818,111.04	91,818,111.04

## 汇添金货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,664,431,192.25	2,664,431,192.25
本期申购	8,685,323,137.01	8,685,323,137.01
本期赎回（以“-”号填列）	-8,791,058,662.66	-8,791,058,662.66
本期末	2,558,695,666.60	2,558,695,666.60

## 汇添金货币 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,000.59	1,000.59
本期申购	15,039,714.79	15,039,714.79
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	15,040,715.38	15,040,715.38

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；C 类和 D 类基金份额不进行自动升降级。

## 6.4.7.8 未分配利润

## 汇添金货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	780,443.15	-	780,443.15
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-780,443.15	-	-780,443.15
本期末	-	-	-

## 汇添金货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	23,168,771.22	-	23,168,771.22
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	-23,168,771.22	-	23,168,771.22
本期末	-	-	-

## 汇添金货币 D

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	39,714.79	-	39,714.79
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	-39,714.79	-	-39,714.79
本期末	-	-	-

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	420,408.67
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	420,408.67

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

## 6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

**6.4.7.11 基金投资收益**

注：本基金本报告期内无基金投资收益。

**6.4.7.12 债券投资收益****6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	19,716,612.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,126,438.71
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	20,843,051.30

**6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,761,087,263.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,728,418,594.10
减：应计利息总额	31,542,030.63
减：交易费用	200.00
买卖债券差价收入	1,126,438.71

**6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.13 资产支持证券投资收益****6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

注：本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益。

**6.4.7.18 其他收入**

注：本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.19 信用减值损失**

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	4,972.24
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

银行汇划费	43,170.60
账户维护费	18,600.00
合计	126,415.18

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要说明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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
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
博正资本投资有限公司（“博正资本”）	受基金管理人独资股东控制的公司
渤海创富证券投资有限公司（“渤海创富”）	受基金管理人独资股东控制的公司

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

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

## 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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	-	-	7,101,250.00	100.00%

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
渤海证券	179,100,000.00	100.00%	-	-

## 6.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

## 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

## 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,637,150.71	1,717,314.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	735,001.23	252,789.84
应支付基金管理人的净管理费	2,902,149.48	1,464,525.02

注：支付基金管理人渤海汇金资管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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,212,383.62	572,438.26

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。

**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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	汇添金货币 A	汇添金货币 B	汇添金货 币 C	汇添金货 币 D	合计
渤海汇金资管	111,713.96	116,548.18	-	221.63	228,483.77
合计	111,713.96	116,548.18	-	221.63	228,483.77
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 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				
	汇添金货币 A	汇添金货币 B	汇添金货 币 C	汇添金货 币 D	合计
渤海汇金资管	72,213.23	54,355.33	-	-	126,568.56
合计	72,213.23	54,355.33	-	-	126,568.56

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资管，再由渤海汇金资管计算并支付给各基金销售机构。

A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%、0.25%和 0.01%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 A/B/C/D 类基金资产净值 × 约定年费率 / 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**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方发生重大转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方发生重大转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

##### 汇添金货币 B

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2017 年 07 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	225,326,430.49	51,458,979.29
报告期间申购/买入总份额	93,826,159.24	590,418.42
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	121,700,000.00	-
报告期末持有的基金份额	197,452,589.73	52,049,397.71
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	7.72%	3.22%

##### 汇添金货币 D

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2017 年 07 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	15,037,719.43	-
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	15,037,719.43	-
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	99.98%	-

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金基金合同和招募说明书的规定执行。

##### 6.4.10.5.2 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

##### 汇添金货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
博正资本投资有限公司	101,035,251.59	3.95%	100,040,881.96	3.75%
渤海创富证券投资有限公司	50,178,770.90	1.96%	-	-

## 6.4.10.6 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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
中国银行股份有限公司	137,325,014.99	420,408.67	1,158,392.54	2,512.30

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。

## 6.4.10.7 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有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

## 6.4.10.8 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。

## 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

## 汇添金货币 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
780,443.15	-	-	780,443.15	-

## 汇添金货币 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
23,168,771.22	-	-	23,168,771.22	-

## 汇添金货币 D

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
39,714.79	-	-	39,714.79	-

#### 6.4.12 期末（2024 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

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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 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从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了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，由稽核部门为风险管理的督导审计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。

#### 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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理制度，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，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。

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	621,631,015.00	779,909,710.35
合计	621,631,015.00	779,909,710.35

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债券及短期融资券等无债项评级的债券。

##### 6.4.13.2.2 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,004,870,575.84	916,307,873.11
合计	1,004,870,575.84	916,307,873.11

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，同业存单无债项评级。

## 6.4.13.2.3 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	30,828,727.73
AAA 以下	-	-
未评级	-	82,421,668.39
合计	-	113,250,396.12

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券均为政策性金融债券。

## 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。

## 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)以及根据份额持有人集中度情况调整投资组合的方式来实现。

本基金管理人管理的全部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%。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 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。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不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 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%。

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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 06 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						
货币资金	137,325,014.99	-	-	-	-	137,325,014.99
交易性金融资产	1,283,370,459.26	343,131,131.58	-	-	-	1,626,501,590.84
买入返售金融资产	857,772,013.06	-	-	-	-	857,772,013.06
应收申	-	-	-	-	44,970,000.00	44,970,000.00

购款						
资产总计	2,278,467,487.31	343,131,131.58	-	-	44,970,000.00	2,666,568,618.89
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	594,447.96	594,447.96
应付托管费	-	-	-	-	198,149.35	198,149.35
应付销售服务费	-	-	-	-	37,733.92	37,733.92
应交税费	-	-	-	-	33,243.61	33,243.61
其他负债	-	-	-	-	150,551.03	150,551.03
负债总计	-	-	-	-	1,014,125.87	1,014,125.87
利率敏感度缺口	2,278,467,487.31	343,131,131.58	-	-	43,955,874.13	2,665,554,493.02
上年度末 2023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						
货币资金	101,557,541.92	-	-	-	14,981.45	101,572,523.37
交易性金融资产	1,747,582,743.35	50,154,629.93	-	-	11,730,606.30	1,809,467,979.58
买入返售金融资产	967,984,272.97	-	-	-	807,604.37	968,791,877.34
资产总计	2,817,124,558.24	50,154,629.93	-	-	12,553,192.12	2,879,832,380.29
负债						
卖出回购金融资产款	99,999,750.00	-	-	-	10,050.51	100,009,800.51
应付管理人报	-	-	-	-	524,679.55	524,679.55

酬						
应付托管费	-	-	-	-	174,893.21	174,893.21
应付销售服务费	-	-	-	-	41,723.01	41,723.01
应交税费	-	-	-	-	75,057.10	75,057.10
其他负债	-	-	-	-	205,471.70	205,471.70
负债总计	99,999,750.00	-	-	-	1,031,875.08	101,031,625.08
利率敏感度缺口	2,717,124,808.24	50,154,629.93	-	-	11,521,317.04	2,778,800,755.21

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日

#### 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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有权益类证券，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投	-	-	-	-

资				
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,626,501,590.84	61.02	1,797,737,373.28	64.69
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,626,501,590.84	61.02	1,797,737,373.28	64.69

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	1,626,501,590.84	1,809,467,979.58
第三层次	-	-
合计	1,626,501,590.84	1,809,467,979.58

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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。

#### 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货币资金、买入返售金融资产等，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	1,626,501,590.84	61.00
	其中：债券	1,626,501,590.84	61.00
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	857,772,013.06	32.17
	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	137,325,014.99	5.15
4	其他各项资产	44,970,000.00	1.69
5	合计	2,666,568,618.89	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	0.42	
	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

注：本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

### 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	61
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	78
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

#### 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。

#### 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(天数)	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	53.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	13.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	6.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	4.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	20.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	98.14	-

#### 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

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。

#### 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	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	621,631,015.00	23.32
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,004,870,575.84	37.70
8	其他	-	-
9	合计	1,626,501,590.84	61.02
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	112382215	23 广州银行 CD050	500,000	49,989,544.14	1.88
2	112419012	24 恒丰银行 CD012	500,000	49,971,269.51	1.87
3	112490649	24 晋商银行 CD006	500,000	49,959,267.11	1.87
4	112497495	24 中原银行 CD120	500,000	49,936,500.51	1.87
5	112497613	24 四川银行 CD045	500,000	49,933,789.46	1.87
6	112491747	24 中原银行 CD025	500,000	49,905,955.47	1.87
7	112498085	24 桂林银行 CD096	500,000	49,893,645.99	1.87
8	112312117	23 北京银行 CD117	500,000	49,848,242.62	1.87
9	112409010	24 浦发银行 CD010	500,000	49,490,372.87	1.86
10	112414010	24 江苏银行 CD010	500,000	49,470,408.44	1.86

## 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	0.1379%

报告期内偏离度的最低值	0.0677%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0987%

#### 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。

#### 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

注：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。

##### 7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本报告期内未发现本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

##### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	44,970,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	44,970,000.00

注：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有尾差。

## § 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
汇添金货币 A	5,598	16,401.95	41,759,182.38	45.48%	50,058,928.66	54.52%
汇添金货币 B	61	41,945,830.60	2,558,695,666.60	100.00%	-	-
汇添金货币 C	-	-	-	-	-	-
汇添金货币 D	2	7,520,357.69	15,039,705.23	99.99%	1,010.15	0.01%
合计	5,660	470,946.02	2,615,494,554.21	98.12%	50,059,938.81	1.88%

注：期末有 1 名基金份额持有人同时持有汇添金货币 B 份额和汇添金货币 D 份额。

### 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	券商类机构	212,518,370.79	7.97%
2	银行类机构	172,829,874.62	6.48%
3	基金类机构	150,026,571.43	5.63%
4	基金类机构	150,019,809.19	5.63%
5	其他机构	143,180,500.57	5.37%
6	券商类机构	136,977,258.20	5.14%
7	其他机构	101,035,251.59	3.79%
8	银行类机构	100,978,293.13	3.79%
9	银行类机构	100,118,610.71	3.76%
10	信托类机构	100,017,714.30	3.75%
10	银行类机构	100,017,714.30	3.75%

### 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	汇添金货币 A	3,004,037.63	3.27%

有本基金	汇添金货币 B	0.00	0.00%
	汇添金货币 C	0.00	0.00%
	汇添金货币 D	1,010.15	0.01%
	合计	3,005,047.78	0.11%

#### 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	汇添金货币 A	0~10
	汇添金货币 B	0
	汇添金货币 C	0
	汇添金货币 D	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添金货币 A	0
	汇添金货币 B	0
	汇添金货币 C	0
	汇添金货币 D	0
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇添金货币 A	汇添金货币 B	汇添金货币 C	汇添金货币 D
基金合同生效日（2017 年 07 月 25 日）基金份额总额	1,358,834,880.84	974,152,707.93	-	-
本报告期期初基金份额总额	114,368,562.37	2,664,431,192.25	-	1,000.59
本报告期基金总申购份额	280,715,226.70	8,685,323,137.01	-	15,039,714.79
减：本报告期基金总赎回份额	303,265,678.03	8,791,058,662.66	-	-
本报告期期末基金份额总额	91,818,111.04	2,558,695,666.60	0.00	15,040,715.38

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。

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 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

本基金基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2024 年 1 月 20 日发布公告，自 2024 年 1 月 19 日起，麻众志先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的总经理助理。

2、本基金管理人于 2024 年 3 月 16 日发布公告，自 2024 年 3 月 15 日起，吴国威先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的总经理，原代任总经理齐朝晖先生离任。

3、本基金管理人于 2024 年 3 月 30 日发布公告，经管理人股东单位渤海证券股份有限公司决定，任命吴国威同志为公司董事，任期至公司第三届董事会届满。

4、本基金管理人于 2024 年 4 月 27 日发布公告，经管理人股东单位渤海证券股份有限公司决定，委派王延敏同志为公司第三届董事会独立董事，任期至公司第三届董事会任期届满之日止。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本基金基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 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。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 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

注：本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受到稽查或处罚的情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
渤海证券	2	-	-	-	-	-

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、本基金本报告期内无新增券商交易单元。

## 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
渤海证券	-	-	179,100,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 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。

## 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	渤海汇金汇添金货币市场基金恢复申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站	2024-01-02
2	渤海汇金汇添金货币市场基金恢复申购（含定期定额投资）业务的公告	证券时报	2024-01-05
3	2024 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、证券时报	2024-01-20
4	渤海汇金汇添金货币市场基金 2023 年第 4 季度报告	公司网站	2024-01-22
5	渤海汇金证券资产管理有限公司	证券时报	2024-01-22

	司旗下基金 2023 年第 4 季度报告的提示性公告		
6	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富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、证券时报	2024-02-05
7	渤海汇金汇添金货币市场基金 2024 年春节前暂停申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站、证券时报	2024-02-05
8	渤海汇金汇添金货币市场基金恢复申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站、证券时报	2024-02-19
9	渤海汇金汇添金货币市场基金招募说明书(更新)（2024 年第 1 号）	公司网站	2024-03-15
10	渤海汇金汇添金货币市场基金基金产品资料概要（更新）	公司网站	2024-03-15
11	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新提示性公告	证券时报	2024-03-15
12	2024 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、证券时报	2024-03-16
13	渤海汇金证券资产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代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报	2024-03-26
14	渤海汇金汇添金货币市场基金 2023 年年度报告	公司网站	2024-03-29
15	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告的提示性公告	证券时报	2024-03-30
16	渤海汇金汇添金货币市场基金 2024 年清明节前暂停申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站、证券时报	2024-03-29
17	渤海汇金汇添金货币市场基金恢复申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站、证券时报	2024-04-08
18	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧基金销售有限公司为代	公司网站、证券时报	2024-04-17

	销机构并参与基金费率优惠活动的公告		
19	渤海汇金汇添金货币市场基金调整部分代销机构以及直销服务大额申购（含大额定期定额投资）业务金额限额的公告	公司网站、证券时报	2024-04-19
20	渤海汇金汇添金货币市场基金 2024 年第 1 季度报告	公司网站	2024-04-22
21	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告的提示性公告	证券时报	2024-04-22
22	渤海汇金汇添金货币市场基金 2024 年劳动节前暂停申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站、证券时报	2024-04-25
23	渤海汇金汇添金货币市场基金恢复申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站、证券时报	2024-05-06
24	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资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	公司网站、证券时报	2024-05-23
25	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加和讯信息科技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、证券时报	2024-05-31
26	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海国信嘉利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、证券时报	2024-05-31
27	渤海汇金汇添金货币市场基金 2024 年端午节前暂停申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站、证券时报	2024-06-04
28	渤海汇金汇添金货币市场基金恢复申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站、证券时报	2024-06-11
29	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加中国邮政储蓄银行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	公司网站、证券时报	2024-06-21
30	渤海汇金汇添金货币市场基金	公司网站	2024-06-26

	基金产品资料概要更新		
31	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下部分基金基金产品资料概要更新提示性公告	证券时报	2024-06-26
32	渤海汇金汇添金货币市场基金调整部分代销机构大额申购（含大额定期定额投资）业务金额限额的公告	公司网站、证券时报	2024-06-27
33	渤海汇金汇添金货币市场基金调整部分代销机构大额申购（含大额定期定额投资）业务金额限额的公告	公司网站、证券时报	2024-06-27

## § 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

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

### 12.3 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或中国证监会基金电子披露网站上查阅，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：400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjmc.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

渤海汇金证券资产管理有限公司

二〇二四年八月三十一日