

**渤海汇金证券资产管理有限公司**  
**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)**

**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**

**截止日：2018 年 07 月 25 日**

## 重要提示

本基金募集申请已于 2017 年 5 月 16 日获中国证监会证监许可【2017】728 号文准予募集注册。本基金的基金合同于 2017 年 7 月 25 日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于货币市场，每万份基金已实现收益、7 日年化收益率会因为货币市场波动等因素产生波动。投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、信用风险、管理风险、估值风险、流动性风险、本基金的特定风险和其他风险等。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。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

投资有风险，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策，自行承担投资风险。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并按监管要求履行相关程序。

基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基

金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50% 的除外。本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 7 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 6 月 30 日（未经审计）。

## 第一部分基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区海岸大厦西座2901、2913室

成立日期：2016年5月18日

法定代表人：徐海军

注册资本：11亿元人民币

联系人：魏文婷

联系电话：010-68784295

股权结构：

股东	出资额 (万元人民币)	出资比例 (%)
渤海证券股份有限公司	110,000	100
合计	110,000	100

经营范围：证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员基本情况

徐海军先生，董事长，南开大学法学硕士。1996年参加工作，历任南方证券天津解放路营业部业务员、南方证券天津分公司资产保全部副经理；2001年3月至2007年6月，任渤海证券股份有限公司法律事务部经理、北京总部总经理等职；2007年6月至2017年6月，任渤海证券股份有限公司合规总监、首席风险官兼风险控制总部总经理；2017年7月至2017年9月任渤海证券股份有限公司合规总监、财务总监；2017年9月至今任渤海证券股份有限公司财务总监。2016年9月至2017年7月，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监、首席风险官；2017年7月至2017年9月，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监；2017年9月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事长。

周磊先生，董事、总经理，天津大学工学硕士。20年证券投资、资产管理经验，国内少有参与过股票、权证、ETF自动化套利、股指期货研究投资的全能

型跨市场、跨品种投资专家。2010年起进入渤海证券股份有限公司任资产管理总部总经理。2016年7月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司总经理。

屈艳霞女士，董事、副总经理兼市场总监，中央财经大学金融学学士。逾15年证券从业经历，10年资产管理业务经验。2010年起进入渤海证券股份有限公司任资产管理总部副总经理兼营销总监；2014年3月起，任渤海证券股份有限公司基金管理总部副总经理（主持工作）。2016年7月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司副总经理兼市场总监。

赵颖女士，董事，南开大学工商管理硕士。2011年进入渤海证券股份有限公司任人力资源管理总部总经理；2012年11月至2015年4月，任渤海证券股份有限公司研究所所长兼人力资源总部总经理；2015年4月至2017年12月，任渤海证券股份有限公司人力资源总部总经理；2017年9月份起，兼任渤海证券股份有限公司债券融资总部总经理，2017年12月份起，兼任渤海证券股份有限公司债权业务总监；2016年7月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事。

刘嫣女士，董事、合规总监，大连海事大学法学硕士。2001年进入渤海证券股份有限公司，逾15年证券业法务与风险管理经验。2001年起历任渤海证券股份有限公司总裁办法律事务部副经理、风险控制总部法律事务部经理、风险控制总部副总经理、公司首席律师；2015年6月起，任渤海证券股份有限公司法律合规总部总经理；2017年9月至今，任渤海证券股份有限公司合规总监兼法律合规总部总经理。2016年7月起，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事；2017年9月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监。

## 2、监事基本情况

刘彤先生，监事，南开大学工商管理硕士。2002年7月进入渤海证券股份有限公司，现担任渤海证券股份有限公司法律合规总部副总经理兼合规管理一部经理、公司律师。2017年5月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司监事。

## 3、高级管理人员基本情况

周磊先生，董事、总经理，天津大学工学硕士。20年证券投资、资产管理经验，国内少有参与过股票、权证、ETF自动化套利、股指期货研究投资的全能

型跨市场、跨品种投资专家。2010年起进入渤海证券股份有限公司任资产管理总部总经理。2016年7月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司总经理。

屈艳霞女士，董事、副总经理兼市场总监，中央财经大学金融学学士。逾15年证券从业经历，10年资产管理业务经验。2010年起进入渤海证券股份有限公司任资产管理总部副总经理兼营销总监；2014年3月起，任渤海证券股份有限公司基金管理总部副总经理（主持工作）。2016年7月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司副总经理兼市场总监。

周里勇先生，董事会秘书、副总经理兼财务负责人，南开大学经济学学士、中国人民大学工商管理硕士。从事证券投资研究及相关领域的管理工作近二十年，实践经验非常丰富。2010年起进入渤海证券股份有限公司任证券投资总部负责人。2016年7月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司副总经理，先后兼任投资一部总经理、证券投资部总经理；2017年7月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司财务负责人。2018年7月起，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事会秘书。

刘嫣女士，董事、合规总监，大连海事大学法学硕士。2001年进入渤海证券股份有限公司，逾15年证券业法务与风险管理经验。2001年起历任渤海证券股份有限公司总裁办法律事务部副经理、风险控制总部法律事务部经理、风险控制总部副总经理、公司首席律师；2015年6月起，任渤海证券股份有限公司法律合规总部总经理；2017年9月至今，任渤海证券股份有限公司合规总监兼法律合规总部总经理。2016年7月起，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事；2017年9月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监。

李颖女士，首席风险官，天津财经学院会计系国际会计专业毕业，在职攻读南开大学金融系金融学专业研究生，获取硕士学位。本科毕业后在天津会计师事务所（后改制为天津津源会计师事务所、五洲联合会计师事务所）从事审计，任项目经理、部门经理、报告终身复核人。2001年进入渤海证券股份有限公司，历任财务总部总经理助理、副总经理、总经理；2015年3月，任渤海证券股份有限公司财务负责人；2017年7月起，任渤海证券股份有限公司首席风险官兼风险控制总部总经理。2017年7月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司首席风险官。

#### 4、本基金拟任基金经理

何翔先生，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，现任公募投资总监、公募投资部经理。

林思先生，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。

李杨女士，天津财经大学国际经济与贸易学士。2011年9月至2014年4月就职于包商银行金融市场部，任债券交易员。2014年5月至2016年8月就职于天津银行金融市场部，任债券交易员。2016年9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。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：

屈艳霞女士，副总经理，简历同上。

委员：

何翔先生，简历同上。

吕晓雯女士，市场副总监。中国人民大学经济学硕士。10年证券从业经验，获得中国证券业协会颁发的证券从业资格证书和中国证券投资基金业协会颁发的基金从业资格证书。2008年6月至2010年8月就职于申万宏源证券有限公司，任北京资产管理分公司高端客户经理。2010年8月至2016年8月就职于渤海证券资产管理总部，先后任营销副总监、项目管理部经理。2016年8月加入渤海汇金证券资产管理有限公司，任市场副总监，兼渠道销售部总经理及客户服务部总经理。

李杨女士，简历同上。

张研女士，风险控制部风控经理，西南财经大学本科。具有10年证券从业经验，获得中国证券业协会颁发的证券从业资格证书和中国证券投资基金业协会颁发的基金从业资格证书。2007年-2015年曾在新时代证券财务部任职。2015

年内调到新时代证券的风险控制部，主要负责资产管理业务的风控阈值管理、合同文本审核和主动管理型产品立项审核。2017年4月份加入渤海汇金证券资产管理有限公司，负责公募基金风险控制管理工作。

陈天彤女士，助理研究员。英国剑桥大学金融经济学硕士，3年证券从业经验，获得中国证券业协会颁发的证券从业资格证书和中国证券投资基金业协会颁发的基金从业资格证书。2015年5月至2016年8月就职于渤海证券，任助理研究员；2016年8月至今就职于渤海汇金证券资产管理有限公司，任助理研究员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 第二部分基金托管人

### 一、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### 二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管



增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### 三、证券投资基金托管情况

截至 2018 年 6 月 30 日，中国银行已托管 674 只证券投资基金，其中境内基金 638 只，QDII 基金 36 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 第三部分相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

成立日期：2016 年 5 月 18 日

法定代表人：徐海军

联系人：谭如雁

电话：022-23861525

传真：022-23861510

网址：<https://www.bhhjamc.com>

客服电话：4006515988，4006511717

#### 2、其他销售机构：

##### （1）中国银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

电话：010-66596688

传真：010-66594946

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

客服电话：95566

##### （2）渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

电话：022-28451922

传真：022-28451892

网址：<http://www.ewww.com.cn/>

客服电话：4006515988

(3) 上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

电话：021-20613999

传真：021-68596919

网址：<https://www.howbuy.com/>

客服电话：4007009665

(4) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：丁姗姗

电话：010-65980380

传真：021-54509953

网址：<http://fund.eastmoney.com/>

客服电话：4001818188

(5) 交通银行股份有限公司

地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

网址：<http://www.bankcomm.com/>

客服电话：95559

（6）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

电话：010-85127609

传真：010-85127917

网址：<http://www.msq.com/>

客服电话：95376/400-619-8888

（7）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：李关洲

电话：021-65370077

传真：021-55085991

网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

客服电话：400-820-5369

（8）天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人：丁东华

联系人：许艳

电话：010-59287105

网址：<https://www.gomefund.com/>

客服电话：400-111-0889

（9）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333910

传真：021-50498825

网址：<http://www.longone.com.cn/>

客服电话：95531、4008888588

## 二、登记机构

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：徐海军

联系人：魏文婷

电话：010-68784295

传真：010-68784289

网址：<https://www.bhhjamc.com>

其他销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

## 三、律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：安冬、陆奇

## 四、会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国上海自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：中国北京朝阳区东三环中路 7 号财富中心 A 座 26 层

法定代表人：李丹

电话：010-65338888

经办注册会计师：李铁英、朱辉

联系人：朱辉

## 第四部分基金的名称

本基金名称：渤海汇金汇添金货币市场基金

## 第五部分基金的类型

本基金类型：货币市场基金。

## 第六部分基金的投资目标

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。

## 第七部分基金的投资方向

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：

- 1、现金；
- 2、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；
- 3、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；
- 4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 第八部分基金的投资策略

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：

### 1、资产配置策略

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。

## 2、个券选择策略

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。

## 3、利率分析策略

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。

## 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。

## 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。

## 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。

## 第九部分基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）

## 第十部分基金的风险收益特征

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。

## 第十一部分基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 6 月 30 日（未经审计）。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	245,257,944.06	72.63
	其中：债券	245,257,944.06	72.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	89,428,814.15	26.48
	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	1,915,177.18	0.57
4	其他资产	1,075,036.30	0.32
5	合计	337,676,971.69	100.00

### 2. 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	0.14
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	4,999,877.50	1.50
	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。

### 3. 基金投资组合平均剩余期限

#### 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	45



报告期内投资组合平均剩余期限最高值	47
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

### 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。

### 3.2 报告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	42.51	1.50
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	19.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	35.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	3.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.27	1.50

### 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。

### 5. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	12,623,943.99	3.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,996,647.05	6.02
	其中：政策性金融债	19,996,647.05	6.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,001,133.89	6.02
6	中期票据	-	-
7	同业存单	192,636,219.13	57.96
8	其他	-	-
9	合计	245,257,944.06	73.79

10	剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券	-	-
----	--------------------------	---	---

## 6. 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	111714268	17 江苏银行 CD268	300,000	29,732,256.93	8.95
2	111714238	17 江苏银行 CD238	200,000	19,883,509.25	5.98
3	111811132	18 平安银行 CD132	200,000	19,874,579.89	5.98
4	111809182	18 浦发银行 CD182	200,000	19,841,868.31	5.97
5	011800042	18 河钢集 SCP001	100,000	10,000,712.02	3.01
6	011801179	18 豫交投 SCP003	100,000	10,000,421.87	3.01
7	170308	17 进出 08	100,000	10,000,268.90	3.01
8	170410	17 农发 10	100,000	9,996,378.15	3.01
9	111713073	17 浙商银行 CD073	100,000	9,978,827.65	3.00
10	111895932	18 徽商银行 CD070	100,000	9,974,050.11	3.00

## 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1438%
报告期内偏离度的最低值	0.0162%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0603%

### 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. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 9. 投资组合报告附注

### 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。

**9.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。**

### 9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,075,036.30
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,075,036.30

### 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。

## 第十二部分基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本基金合同生效日 2017 年 7 月 25 日，基金业绩数据截至 2018 年 6 月 30 日。

### 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	净值收益率①	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
2017/07/25-2017/12/31	1.5987%	0.0022%	0.1534%	0.0000%	1.4453%	0.0022%
2018/01/01-2018/06/30	1.8323%	0.0019%	0.1736%	0.0000%	1.6587%	0.0019%
自基金合同生效日 (2017/07/25) -2018/06/30	3.4603%	0.0020%	0.3270%	0.0000%	3.1333%	0.0020%

## 渤海汇金汇添金货币 B

阶段	净值收 益率①	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
2017/07/25-2017/12/31	1.7065%	0.0022%	0.1534%	0.0000%	1.5531%	0.0022%
2018/01/01-2018/06/30	1.9542%	0.0019%	0.1736%	0.0000%	1.7806%	0.0019%
自基金合同生效日 (2017/07/25) -2018/06/30	3.6940%	0.0020%	0.3270%	0.0000%	3.3670%	0.0020%

注：本货币基金收益分配按日结转份额。

### 第十三部分基金费用与税收

#### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与

基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，应自其升级后的下一个工作日起适用 B 类基金份额的费率。

A 类、B 类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H=E \times \text{该类基金份额的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人指令或

按照行业惯例从基金财产中支付，如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，必须在该会计期间内按直线法摊销。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

根据相关税收规定，自 2018 年 1 月 1 日起，证券投资基金运营过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征税率缴纳增值税。管理人将对本基金运营过程中产生的增值税及附加税费在基金财产中计提，并由管理人按照现行规定缴纳。具体公告见 2017 年 12 月 29 日基金管理人在公司网站发布的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下证券投资基金执行增值税政策的公告》。

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十四部分对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对 2018 年 3 月 9 日公告的《渤海汇金汇添金货币市场基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

1. “重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2. “第一部分绪言”部分：更新了相关内容。

3. “第二部分释义”部分：更新了相关内容。
4. “第三部分基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。
5. “第四部分基金托管人”部分：更新了托管人的相关信息。
6. “第五部分相关服务机构”部分：更新了其他销售机构信息。
7. “第八部分基金份额的申购与赎回”部分：更新了相关内容。
8. “第九部分基金的投资”部分：更新了相关内容。
9. “第十部分基金投资组合报告”部分：更新了本基金 2018 年第 2 季度投资组合报告内容。该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。
10. “第十一部分基金业绩”部分：更新了自基金生效日至 2018 年 6 月 30 日的基金业绩，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。
11. “第十三部分基金资产的估值”部分：更新了相关内容。
12. “第十七部分基金的信息披露”部分：更新了相关内容。
13. “第十八部分风险揭示”部分：更新了流动性风险的相关内容。
14. “第二十部分基金合同的内容摘要”部分：更新了相关内容。
15. “第二十一部分基金托管协议的内容摘要”部分：更新了相关内容。
16. “第二十三部分其他应披露事项”部分：列示了报告期内披露的涉及本基金及基金管理人的相关公告。

渤海汇金证券资产管理有限公司

二〇一八年九月七日