

渤海汇金汇添金货币市场基金

2025 年年度报告

2025 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

报告送出日期:2026 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2025年01月01日起至2025年12月31日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 1 |
| 1.1 重要提示 | 1 |
| 1.2 目录 | 2 |
| § 2 基金简介 | 4 |
| 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 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 | 13 |
| § 4 管理人报告 | 14 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 14 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 16 |
| 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 | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 17 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 17 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 18 |
| 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 | 18 |
| 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 | 18 |
| § 5 托管人报告 | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 18 |
| 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 | 18 |
| 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 | 19 |
| § 6 审计报告 | 19 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 19 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 19 |
| § 7 年度财务报表 | 21 |
| 7.1 资产负债表 | 21 |
| 7.2 利润表 | 22 |
| 7.3 净资产变动表 | 23 |
| 7.4 报表附注 | 24 |
| § 8 投资组合报告 | 50 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 50 |
| 8.2 债券回购融资情况 | 51 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限 | 51 |
| 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 | 52 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 52 |

| | |
|--|-----------|
| 8.6 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 | 52 |
| 8.7 “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 | 53 |
| 8.8 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 | 53 |
| 8.9 投资组合报告附注 | 53 |
| § 9 基金份额持有人信息 | 54 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 54 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 | 55 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 55 |
| 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情况 | 55 |
| 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 | 55 |
| § 10 开放式基金份额变动 | 56 |
| § 11 重大事件揭示 | 56 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 56 |
| 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 | 56 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 57 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 57 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 57 |
| 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 | 57 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 58 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 | 59 |
| 11.9 其他重大事件 | 59 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| 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 | 63 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| § 13 备查文件目录 | 64 |
| 13.1 备查文件目录 | 64 |
| 13.2 存放地点 | 64 |
| 13.3 查阅方式 | 64 |

§ 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 | 5,286,065,606.15 份 | | | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | | | |
| 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 | 汇添金货币 E |
| 下属分级基金的交易代码 | 004786 | 004787 | 019634 | 019635 | 021763 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 111,921,741.04 份 | 3,284,351,994.97 份 | 1,822,023,652.41 份 | 67,768,217.73 份 | 0.00 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、</p> |

| | |
|--------|--|
| | <p>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 | 许俊 |
| | 联系电话 | 022-23861655 | 010-66596688 |
| | 电子邮箱 | liujia@bhhjmc.com | fxjd_hq@bank-of-china.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 | 北京市西城区复兴门内大街 1 |

| | | |
|-------|--|------------------|
| | 道桂湾五路 128 号基金小镇对冲基金中心 506 | 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 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | https://www.bhhjmc.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 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼 |
| 注册登记机构 | 渤海汇金证券资产管理有限公司 | 天津市南开区滨水西道 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 | 2025 年 | | | | | 2024 年 | | | | | 2023 年 | | | | |
|---------------------|--------------|---------------|---------------|------------|---------|--------------|---------------|---------|------------|---------|--------------|---------------|---------|---------|---------|
| | 汇添金货币 A | 汇添金货币 B | 汇添金货币 C | 汇添金货币 D | 汇添金货币 E | 汇添金货币 A | 汇添金货币 B | 汇添金货币 C | 汇添金货币 D | 汇添金货币 E | 汇添金货币 A | 汇添金货币 B | 汇添金货币 C | 汇添金货币 D | 汇添金货币 E |
| 本期已实现收 | 1,154,651.22 | 35,921,369.43 | 15,573,304.74 | 301,524.70 | - | 1,370,503.66 | 41,371,572.55 | - | 166,704.89 | - | 1,647,251.52 | 37,487,463.00 | - | 4.42 | - |

| | | | | | | | | | | | | | | | |
|----------------------|----------------|------------------|------------------|---------------|------|----------------|------------------|------|---------------|------|----------------|------------------|---|----------|---|
| 益 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 本期利润 | 1,154,651.22 | 35,921,369.43 | 15,573,302.04 | 301,524.70 | - | 1,370,503.66 | 41,371,572.55 | - | 166,704.89 | - | 1,647,251.52 | 37,487,463.00 | - | 4.42 | - |
| 本期净值收益率 | 1.2284% | 1.4723% | 0.8618% | 1.4724% | - | 1.6024% | 1.8467% | - | 1.8469% | - | 2.0670% | 2.3119% | - | 0.4233% | - |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2025 年末 | | | | | 2024 年末 | | | | | 2023 年末 | | | | |
| 期末基金资产净值 | 111,921,741.04 | 3,284,351,994.97 | 1,822,023,652.41 | 67,768,721.73 | 0.00 | 112,055,879.72 | 4,072,159,477.43 | 0.00 | 15,166,693.03 | 0.00 | 114,368,562.37 | 2,664,431,192.25 | - | 1,000.59 | - |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | - | 1.0000 | 1.0000 | - | 1.0000 | - | 1.0000 | 1.0000 | - | 1.0000 | - |
| 3.1.3 累计期末 | 2025 年末 | | | | | 2024 年末 | | | | | 2023 年末 | | | | |

| 指标 | | | | | | | | | | | | | | | |
|---------|----------|----------|---------|---------|---|----------|----------|---|---------|---|----------|----------|---|---------|---|
| 累计净值收益率 | 18.2840% | 20.6292% | 0.8618% | 3.7840% | - | 16.8487% | 18.8789% | - | 2.2781% | - | 15.0058% | 16.7234% | - | 0.4233% | - |

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

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.2941% | 0.0017% | 0.0882% | 0.0000% | 0.2059% | 0.0017% |
| 过去六个月 | 0.5668% | 0.0015% | 0.1764% | 0.0000% | 0.3904% | 0.0015% |
| 过去一年 | 1.2284% | 0.0016% | 0.3500% | 0.0000% | 0.8784% | 0.0016% |
| 过去三年 | 4.9764% | 0.0021% | 1.0510% | 0.0000% | 3.9254% | 0.0021% |
| 过去五年 | 8.8094% | 0.0020% | 1.7510% | 0.0000% | 7.0584% | 0.0020% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.2840% | 0.0027% | 2.9553% | 0.0000% | 15.3287% | 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.3550% | 0.0017% | 0.0882% | 0.0000% | 0.2668% | 0.0017% |
| 过去六个月 | 0.6888% | 0.0015% | 0.1764% | 0.0000% | 0.5124% | 0.0015% |
| 过去一年 | 1.4723% | 0.0016% | 0.3500% | 0.0000% | 1.1223% | 0.0016% |
| 过去三年 | 5.7355% | 0.0021% | 1.0510% | 0.0000% | 4.6845% | 0.0021% |
| 过去五年 | 10.1233% | 0.0020% | 1.7510% | 0.0000% | 8.3723% | 0.0020% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.6292% | 0.0027% | 2.9553% | 0.0000% | 17.6739% | 0.0027% |

汇添金货币 C 净值表现

| 阶段 | 份额净值收 | 份额净值收 | 业绩比较基 | 业绩比较基 | ①—③ | ②—④ |
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|

| | 益率① | 益率标准差② | 准收益率③ | 准收益率标准差④ | | |
|------------|---------|---------|---------|----------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.2942% | 0.0017% | 0.0882% | 0.0000% | 0.2060% | 0.0017% |
| 过去六个月 | 0.5669% | 0.0015% | 0.1764% | 0.0000% | 0.3905% | 0.0015% |
| 过去一年 | 0.8618% | 0.0017% | 0.2541% | 0.0000% | 0.6077% | 0.0017% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.8618% | 0.0017% | 0.2541% | 0.0000% | 0.6077% | 0.0017% |

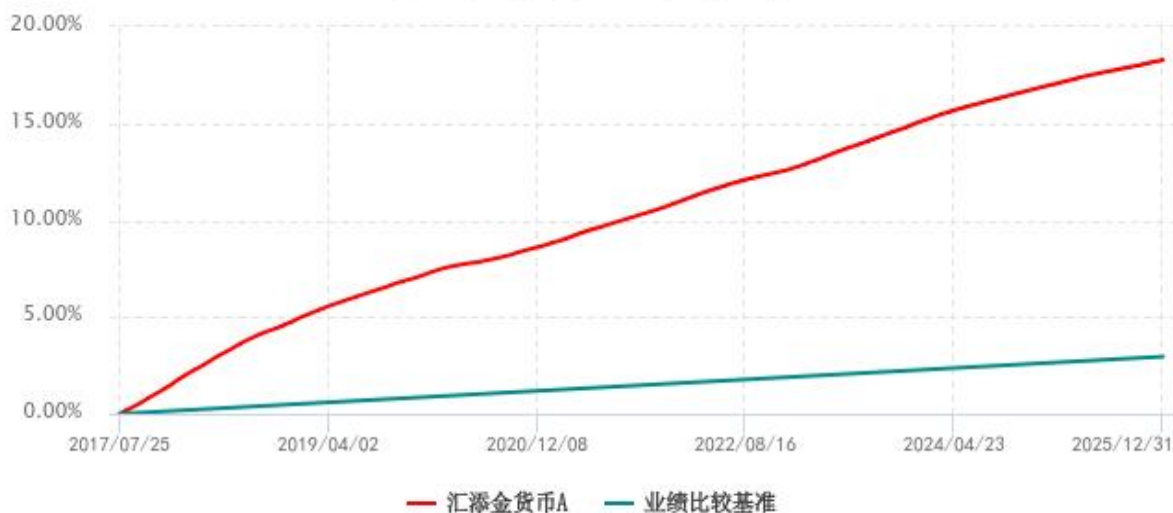
汇添金货币 D 净值表现

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.3551% | 0.0017% | 0.0882% | 0.0000% | 0.2669% | 0.0017% |
| 过去六个月 | 0.6888% | 0.0015% | 0.1764% | 0.0000% | 0.5124% | 0.0015% |
| 过去一年 | 1.4724% | 0.0016% | 0.3500% | 0.0000% | 1.1224% | 0.0016% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.7840% | 0.0019% | 0.7671% | 0.0000% | 3.0169% | 0.0019% |

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-2025年12月31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-2025年12月31日)



汇添金货币C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年04月11日-2025年12月31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-2025年12月31日)



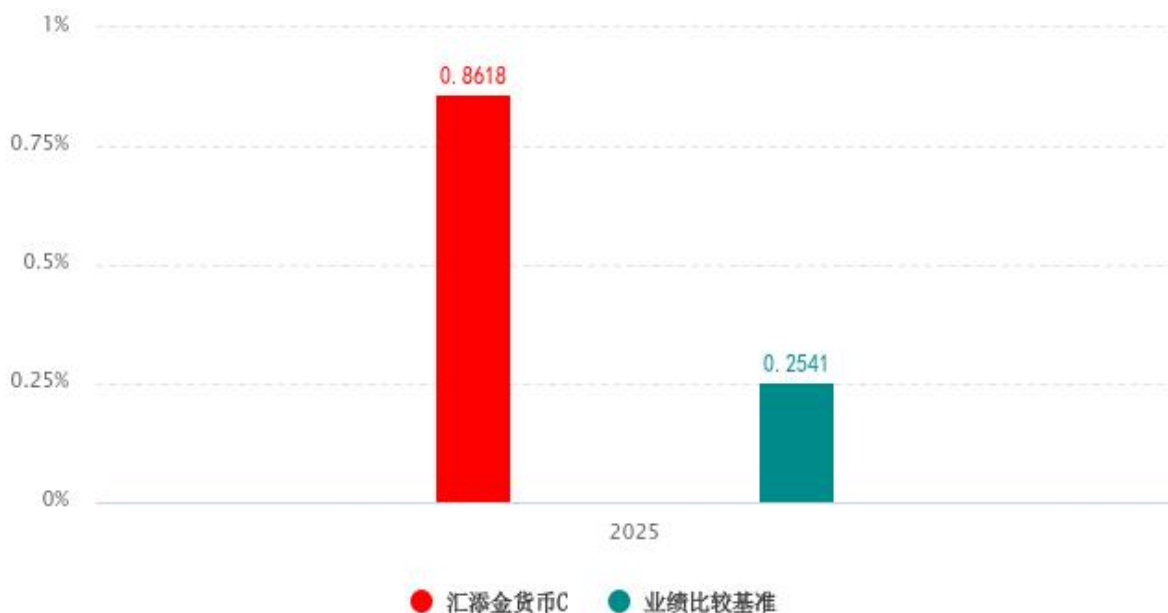
注：1、本基金合同于 2017 年 7 月 25 日生效。

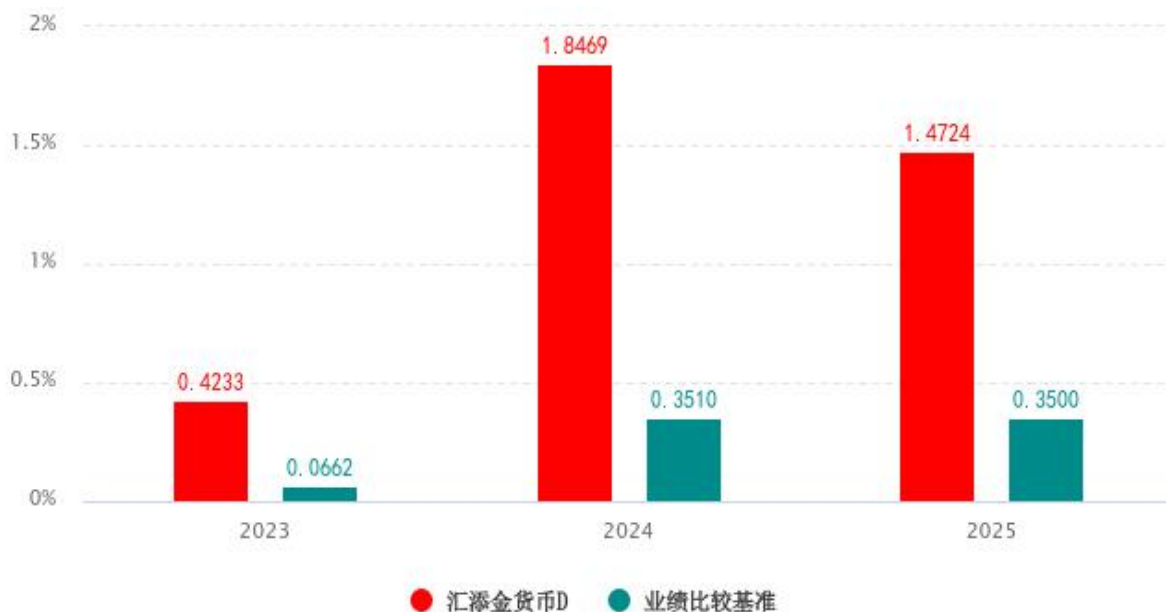
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3、经与托管人协商一致，管理人决定自 2023 年 10 月 9 日起增设 C 类和 D 类基金份额、2024 年 9 月 13 日起增设 E 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 类份额自首笔份额登记日（即 2025 年 4 月 11 日）起披露业绩数据，E 类份额尚无份额登记。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较







注：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类份额自首笔份额登记日（即2025年4月11日）起披露业绩数据，E类份额尚无份额登记，首笔份额登记当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

汇添金货币 A

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应付赎回款 转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|------------------|-------------------|----------|--------------|----|
| 2025年 | 1,154,651.22 | - | - | 1,154,651.22 | - |
| 2024年 | 1,370,503.66 | - | - | 1,370,503.66 | - |
| 2023年 | 1,647,251.52 | - | - | 1,647,251.52 | - |
| 合计 | 4,172,406.40 | - | - | 4,172,406.40 | - |

汇添金货币 B

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应付赎回款 转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|------------------|-------------------|----------|----------------|----|
| 2025年 | 35,921,369.43 | - | - | 35,921,369.43 | - |
| 2024年 | 41,371,572.55 | - | - | 41,371,572.55 | - |
| 2023年 | 37,487,463.00 | - | - | 37,487,463.00 | - |
| 合计 | 114,780,404.98 | - | - | 114,780,404.98 | - |

汇添金货币 C

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资形式 转实收基金 | 直接通过应付赎回款 转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|----|------------------|-------------------|----------|----------|----|
|----|------------------|-------------------|----------|----------|----|

| | | | | | |
|--------|---------------|---|---|---------------|---|
| 2025 年 | 15,573,302.04 | - | - | 15,573,302.04 | - |
| 2024 年 | - | - | - | - | - |
| 2023 年 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 15,573,302.04 | - | - | 15,573,302.04 | - |

汇添金货币 D

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资形式转 实收基金 | 直接通过应付赎回 款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分 配合计 | 备 注 |
|--------|------------------|-------------------|----------|--------------|--------|
| 2025 年 | 301,524.70 | - | - | 301,524.70 | - |
| 2024 年 | 166,704.89 | - | - | 166,704.89 | - |
| 2023 年 | 4.42 | - | - | 4.42 | - |
| 合计 | 468,234.01 | - | - | 468,234.01 | - |

§ 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2025年12月31日，本基金管理人共管理18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、渤海汇金优选价值混合型发起式证券投资基金、渤海汇金1个月持有期债券型发起式证券投资基金、渤海汇金鑫泉平衡混合型发起式证券投资基金、渤海汇金中证全指自由现金流指数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 | 说明 |
|----|----|---------------------|----------|------------------|----|
| | | 任职日期 | 离任 日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | 年限 | |
|----|----------------------|------------|---|-----|---|
| 周珂 | 公募固收部固收投资副总监，本基金基金经理 | 2021-02-23 | - | 5 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

4.1.4 基金经理薪酬机制

不涉及

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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 032 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

不涉及

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

2025 年货币市场利率整体维持震荡下行的走势。银行间市场资金面整体呈现“稳中偏松”格局，央行通过持续加量续作 MLF、重启买断式逆回购及常态化国债买卖操作，有效对冲政府债发行与季节性扰动，保障流动性合理充裕。2025 年央行继续强化政策利率传导，开展结构性工具创新。2025 年货币政策降息一次，年初资金利率与长期资金价格均上行较多，同业存单发行利率最高上行约 50bp。5 月长期资金价格回落至年初位置，随后保持低位震荡。从资金面来看，DR007 与政策利率之差进一步收窄，流动性分层保持低位。银行间市场质押式回购利率 R001、R007、DR001、DR007 平均值分别为：1.58%、1.71%、1.50%、1.63%。商业银行 AAA 等级同业存单利率水平整体震荡下行，1

月、3 月、6 月、1 年期的 AAA 等级商业银行同业存单的平均值为 1.65%、1.67%、1.69%、1.70%。

报告期内，本基金主要配置利率债、同业存单等高信用品质资产，强化负债端管理，科学匹配账户流动性需求。在市场利率处于相对高位时，适度拉长久期以提升收益水平；同时，综合评估各类资产的流动性与收益率性价比，动态优化资产配置结构，在有效控制组合偏离度的前提下，实现估值增值，保障基金稳健运作并持续提升业绩回报。

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 1.2284%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%；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 1.4723%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%；截至报告期末汇添金货币 C 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 0.8618%，同期业绩比较基准收益率为 0.2541%；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 1.4724%，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 2026 年，货币政策大概率仍然稳健宽松，结构性货币政策工具的运用将更加适度、灵活。预计上半年稳增长压力较大，汇率掣肘相对有限，降准、降息仍将存在一定空间。LPR 利率有望继续跟随逆回购利率下调，利率走廊将进一步收窄。公开市场操作将继续加大配合政府债券融资节奏，债券供给对资金面扰动预计将有所减弱。仍需关注海外不确定性因素和权益市场波动对货币市场利率走势的扰动影响。

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，本基金管理人的监察稽核工作以法律法规、行业规范和公司制度为依据，对公司经营管理、基金运作和证券资产管理的各项业务环节进行审计监督，协助公司做到防范和控制风险，保证合法合规、健康持续经营，保护投资者合法权益。

公司稽核工作接受公司党总支和董事会的领导和监督。对公司业务、内部控制、风险管理等实施独立、客观的监督、评价和建议，完成多个评估、稽核项目，包括合规管理有效性评估、全面风险管理评估、公募投资条线常规稽核、信息技术管理审计等多个稽核项目。

报告期内，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、各部门的审计和整改督促。基金管理人认真、严格地履行监察稽核职责，不断完善内部控制的制度体系和组织体系，提高监察稽核工作的规范性和有效性，协助防范和控制重大风险，切实保护基金份额持有人的利益。

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委员会，估值委员会成员由公司总经理、分管公募基金业务的管理人员、合规总监、首席风险官、财务负责人、公募投资部门负责人、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历。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。

4.8 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 52,950,847.39 元，实际分配收益 52,950,847.39 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

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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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的复核，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”、“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）、投资组合报告等财务数据真实、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 | 德师报(审)字(26)第 P03275 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持有人 |
| 审计意见 | 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 2025 年 12 月 31 日的资产负债表,2025 年度的利润表、净资产变动表以及报表附注。 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、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了汇添金货币基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 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。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和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。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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。 |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | 渤海汇金证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括汇添金货币基金 2025 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 |

| | |
|------------------------|---|
| | <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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而导致的重大错报。</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>(1) 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>(2) 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>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> |

| | |
|-----------|---|
| | <p>(4) 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，就可能对导致对汇添金货币市场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市场基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，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 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 杨小真 王亚坤 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼 |
| 审计报告日期 | 2026-03-25 |

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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|----------------------|-----------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 3,284,668.51 | 212,463,393.63 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 3,288,696,799.30 | 2,389,906,353.42 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 3,250,643,551.96 | 2,389,906,353.42 |
| 资产支持证券投资 | | 38,053,247.34 | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|-----------------------------|------------------------------|
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 1,996,504,949.26 | 1,598,067,281.07 |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 5,288,486,417.07 | 4,200,437,028.12 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 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 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,267,363.54 | 621,074.73 |
| 应付托管费 | | 253,472.70 | 124,214.93 |
| 应付销售服务费 | | 571,120.80 | 46,763.01 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 96,423.57 | 47,245.43 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 232,430.31 | 215,679.84 |
| 负债合计 | | 2,420,810.92 | 1,054,977.94 |
| 净资产: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 5,286,065,606.15 | 4,199,382,050.18 |
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | - | - |
| 净资产合计 | | 5,286,065,606.15 | 4,199,382,050.18 |
| 负债和净资产总计 | | 5,288,486,417.07 | 4,200,437,028.12 |

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 5,286,065,606.15 份。其中汇添金货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 111,921,741.04 份；汇添金货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3,284,351,994.97 份；汇添金货币 C 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,822,023,652.41 份；汇添金货币 D 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 67,768,217.73 份；汇添金货币 E 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 0.00 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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|------------|---------------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | 70,183,511.83 | 52,664,713.43 |
| 1. 利息收入 | | 14,095,263.84 | 17,763,853.52 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.9 | 1,622,010.23 | 1,885,412.58 |
| 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 | | 12,473,253.61 | 15,878,440.94 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 56,088,150.77 | 34,900,859.91 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.11 | 55,822,482.51 | 34,900,859.91 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.12 | 265,668.26 | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 97.22 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 17,232,664.44 | 9,755,932.33 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 9,907,050.88 | 6,702,398.56 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 1,981,410.14 | 2,010,705.41 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 3,932,794.10 | 440,840.67 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 1,099,892.88 | 293,262.04 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,099,892.88 | 293,262.04 |
| 6. 信用减值损失 | 7.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 73,475.49 | 58,876.40 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.19 | 238,040.95 | 249,849.25 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 52,950,847.39 | 42,908,781.10 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 52,950,847.39 | 42,908,781.10 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 52,950,847.39 | 42,908,781.10 |

7.3 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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|--|--|----------------|--------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 4,199,382,050.18 | - | 4,199,382,050.18 |
| 二、本期期初净资产 | 4,199,382,050.18 | - | 4,199,382,050.18 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 1,086,683,555.97 | - | 1,086,683,555.97 |
| （一）、综合收益总额 | - | 52,950,847.39 | 52,950,847.39 |
| （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） | 1,086,683,555.97 | - | 1,086,683,555.97 |
| 其中：1. 基金申购款 | 56,109,051,513.82 | - | 56,109,051,513.82 |
| 2. 基金赎回款 | -55,022,367,957.85 | - | -55,022,367,957.85 |
| （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） | - | -52,950,847.39 | -52,950,847.39 |
| 四、本期期末净资产 | 5,286,065,606.15 | - | 5,286,065,606.15 |
| 项目 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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） | 1,420,581,294.97 | - | 1,420,581,294.97 |
| （一）、综合收益总额 | - | 42,908,781.10 | 42,908,781.10 |
| （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） | 1,420,581,294.97 | - | 1,420,581,294.97 |
| 其中：1. 基金申购款 | 21,131,042,787.47 | - | 21,131,042,787.47 |
| 2. 基金赎回款 | -19,710,461,492.50 | - | -19,710,461,492.50 |
| （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） | - | -42,908,781.10 | -42,908,781.10 |
| 四、本期期末净资产 | 4,199,382,050.18 | - | 4,199,382,050.18 |

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：

吴国威

边燕萍

宁晓明

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,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 类和 D 类基金份额,2024 年 9 月 13 日起,在本基金现有基金份额的基础上增加 E 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)。

7.4.2 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。

7.4.3 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值。在本基金存续期间，基金管理人定期计算本基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后采用估值技术确定最能反映公允价值的价格。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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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。

7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

债券投资收益包括债券利息收入以及买卖债券价差收入。基金持有的附息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应收利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括资产支持证券利息收入以及买卖资产支持证券价差收入。基金持有

的资产支持证券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应收利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

(3) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.9 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或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

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：

根据中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财税[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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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) 对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3) 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。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------|-----------------------|
| 活期存款 | 3,284,668.51 | 212,463,393.63 |
| 等于：本金 | 3,254,428.90 | 212,234,891.43 |
| 加：应计利息 | 30,239.61 | 228,502.20 |
| 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 | 3,284,668.51 | 212,463,393.63 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2025 年 12 月 31 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 | 3,250,643,551.96 | 3,252,969,437.27 | 2,325,885.31 | 0.0440 |
| | 合计 | 3,250,643,551.96 | 3,252,969,437.27 | 2,325,885.31 | 0.0440 |
| 资产支持证券 | | 38,053,247.34 | 38,071,247.34 | 18,000.00 | 0.0003 |
| 合计 | | 3,288,696,799.30 | 3,291,040,684.61 | 2,343,885.31 | 0.0443 |
| 项目 | | 上年度末 2024 年 12 月 31 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 | 2,389,906,353.42 | 2,391,991,933.50 | 2,085,580.08 | 0.0497 |
| | 合计 | 2,389,906,353.42 | 2,391,991,933.50 | 2,085,580.08 | 0.0497 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 2,389,906,353.42 | 2,391,991,933.50 | 2,085,580.08 | 0.0497 |

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

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

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 2025 年 12 月 31 日 | |
|----|----------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| | | |

| | | |
|-------|-----------------------|-----------|
| 交易所市场 | 34,207,308.48 | - |
| 银行间市场 | 1,962,297,640.78 | - |
| 合计 | 1,996,504,949.26 | - |
| 项目 | 上年度末 2024 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 | 1,598,067,281.07 | - |
| 合计 | 1,598,067,281.07 | - |

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无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 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 | 93,130.31 | 76,379.84 |
| 其中：交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 93,130.31 | 76,379.84 |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 139,300.00 | 139,300.00 |
| 合计 | 232,430.31 | 215,679.84 |

7.4.7.7 实收基金

汇添金货币 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 112,055,879.72 | 112,055,879.72 |
| 本期申购 | 1,280,381,309.17 | 1,280,381,309.17 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,280,515,447.85 | -1,280,515,447.85 |
| 本期末 | 111,921,741.04 | 111,921,741.04 |

汇添金货币 B

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 上年度末 | 4,072,159,477.43 | 4,072,159,477.43 |
| 本期申购 | 24,841,332,489.56 | 24,841,332,489.56 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -25,629,139,972.02 | -25,629,139,972.02 |
| 本期末 | 3,284,351,994.97 | 3,284,351,994.97 |

汇添金货币 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---------------------------------------|--------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | - | - |
| 本期申购 | 29,932,136,190.39 | 29,932,136,190.39 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -28,110,112,537.98 | -28,110,112,537.98 |
| 本期末 | 1,822,023,652.41 | 1,822,023,652.41 |

汇添金货币 D

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 15,166,693.03 | 15,166,693.03 |
| 本期申购 | 55,201,524.70 | 55,201,524.70 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,600,000.00 | -2,600,000.00 |
| 本期末 | 67,768,217.73 | 67,768,217.73 |

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。

7.4.7.8 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 |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,154,651.22 | - | 1,154,651.22 |
| 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 | -1,154,651.22 | - | -1,154,651.22 |

| | | | |
|-----|---|---|---|
| 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 |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 35,921,369.43 | - | 35,921,369.43 |
| 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 | -35,921,369.43 | - | -35,921,369.43 |
| 本期末 | - | - | - |

汇添金货币 C

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 |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 15,573,302.04 | - | 15,573,302.04 |
| 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 | -15,573,302.04 | - | -15,573,302.04 |
| 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 |
|----------------|------------|-------|------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 301,524.70 | - | 301,524.70 |
| 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 | -301,524.70 | - | -301,524.70 |
| 本期末 | - | - | - |

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------------------------------------|--|
| 活期存款利息收入 | 1,619,190.79 | 1,885,412.58 |
| 定期存款利息收入 | 2,819.44 | - |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 1,622,010.23 | 1,885,412.58 |

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|------------------------------|---------------------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入 | 49,373,647.23 | 32,780,518.82 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 6,448,835.28 | 2,120,341.09 |
| 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 | 55,822,482.51 | 34,900,859.91 |

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---------------------------------------|--|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 15,145,381,632.40 | 6,976,323,389.85 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 15,060,149,829.45 | 6,926,270,870.69 |
| 减：应计利息总额 | 78,783,007.67 | 47,931,978.07 |
| 减：交易费用 | -40.00 | 200.00 |
| 买卖债券差价收入 | 6,448,835.28 | 2,120,341.09 |

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|--------------------------|---------------------------------------|--|
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 265,668.26 | - |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | - | - |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 合计 | 265,668.26 | - |

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 21,220,392.00 | - |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 21,002,400.00 | - |
| 减：应计利息总额 | 217,992.00 | - |
| 减：交易费用 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13 贵金属投资收益**7.4.7.13.1 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。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

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-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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-申购差价收入。

7.4.7.14 衍生工具收益**7.4.7.14.1 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-买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

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-其他投资收益。

7.4.7.15 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。

7.4.7.16 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收益。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|----|---------------------------------------|--|
| | | |

| | | |
|---------|-------|---|
| 基金赎回费收入 | - | - |
| 其他 | 97.22 | - |
| 合计 | 97.22 | - |

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---------|---------------------------------------|--|
| 审计费用 | 10,000.00 | 10,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行汇划费 | 70,840.95 | 82,649.25 |
| 账户维护费 | 37,200.00 | 37,200.00 |
| 合计 | 238,040.95 | 249,849.25 |

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大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：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 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。

7.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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 | 524,120,000.00 | 100.00% | 492,210,000.00 | 100.00% |

7.4.10.1.5 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。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|------------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 9,907,050.88 | 6,702,398.56 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 3,016,250.32 | 1,320,729.82 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 6,890,800.56 | 5,381,668.74 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管 | 1,981,410.14 | 2,010,705.41 |

| | | |
|---|--|--|
| 费 | | |
|---|--|--|

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 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 | 汇添金货币 E | 合计 |
| 渤海汇金资管 | 10,706.99 | 86,123.25 | - | 2,057.72 | - | 98,887.96 |
| 中国银行 | 30,937.90 | 1,040.52 | - | - | - | 31,978.42 |
| 渤海证券 | 11,676.61 | 101.04 | - | - | - | 11,777.65 |
| 合计 | 53,321.50 | 87,264.81 | - | 2,057.72 | - | 142,644.03 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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 | 汇添金货币 E | 合计 |
| 渤海汇金资管 | 4,641.18 | 83,035.73 | - | 980.81 | - | 88,657.72 |
| 中国银行 | 56,160.40 | 656.84 | - | - | - | 56,817.24 |
| 渤海证券 | 13,781.65 | 533.12 | - | - | - | 14,314.77 |
| 合计 | 74,583.23 | 84,225.69 | - | 980.81 | - | 159,789.73 |

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、D 类基金份额和 E 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%、0.01% 和 0.20%。其计算公式为：

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

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

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无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 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 A

份额单位：份

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------------|---------------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期内申购/买入总份额 | 4,645,144.22 | - |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | 4,645,144.22 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 0.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | - |

汇添金货币 B

份额单位：份

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------------|---------------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额 | 207,516,516.41 | 225,378,107.69 |
| 报告期内申购/买入总份额 | 84,974,286.56 | 249,738,408.72 |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | 292,490,802.97 | 267,600,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 0.00 | 207,516,516.41 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00% | 5.10% |

汇添金货币 D

份额单位：份

| 项目 | 本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------------|---------------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额 | 15,166,693.03 | - |
| 报告期内申购/买入总份额 | 55,201,524.70 | 15,166,693.03 |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | 2,600,000.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 67,768,217.73 | 15,166,693.03 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 100.00% | 100.00% |

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入及份额类别调增份额，期间赎回/卖出总份额含转换出及份额类别调增份额。

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。

7.4.10.5.2 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

注：本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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 | 3,284,668.51 | 1,619,190.79 | 212,463,393.63 | 1,885,412.58 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

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 |
|--------------|---------------|----------|--------------|----|
| 1,154,651.22 | - | - | 1,154,651.22 | - |

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 |
|---------------|---------------|----------|---------------|----|
| 35,921,369.43 | - | - | 35,921,369.43 | - |

汇添金货币 C

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 |
|---------------|---------------|----------|---------------|----|
| 15,573,302.04 | - | - | 15,573,302.04 | - |

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 |
|--------------|---------------|----------|----------|----|
| | | | | |

| | | | | |
|------------|---|---|------------|---|
| 301,524.70 | - | - | 301,524.70 | - |
|------------|---|---|------------|---|

7.4.12 期末（2025 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/增发证券而于期末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：本基金本报告期末无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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 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因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

7.4.13 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。

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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司建立了以董事会承担全面风险管理的最终责任，以审计委员会承担全面风险管理的监督责任，以经营层承担全面风险管理的主要责任，以首席风险官负责全面风险管理工作，以风险管理委员会为风险管理工作指导机构，由各类型风险管理工作的主责部门为风险管理的归口管理部门，由各部门、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。公司应当赋予风险管理组织机构、人员足够的权限与资源，建立各部门、各分支机构、风险管理部门、内审部门之间密切协作、相互衔接、有效制衡的运行机制。

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。

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 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 1,096,059,769.97 | 691,676,862.79 |
| 合计 | 1,096,059,769.97 | 691,676,862.79 |

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券均为国债及政策性金融债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| A-1 | 18,007,596.93 | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 18,007,596.93 | - |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

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 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
|--------|----------------------|-----------------------|

| | | |
|--------|------------------|------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 1,613,309,019.06 | 1,544,724,071.79 |
| 合计 | 1,613,309,019.06 | 1,544,724,071.79 |

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。

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 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA | 357,811,258.17 | 132,941,648.24 |
| AAA 以下 | 41,283,097.51 | 20,563,770.60 |
| 未评级 | 142,180,407.25 | - |
| 合计 | 541,274,762.93 | 153,505,418.84 |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。未评级的债券投资包括国债、央行票据和政策性银行金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA | 20,045,650.41 | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 20,045,650.41 | - |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出

7.4.13.3 流动性风险

报告期内本基金组合资产的流动性风险分析本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

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，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。

截至本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

7.4.13.3.1 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。

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 2025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 | 3,254,428.90 | - | - | - | 30,239.61 | 3,284,668.51 |
| 交易性金融资产 | 3,149,616,637.78 | 123,980,076.91 | - | - | 15,100,084.61 | 3,288,696,799.30 |
| 买入返售金融资产 | 1,996,140,942.90 | - | - | - | 364,006.36 | 1,996,504,949.26 |
| 资产总计 | 5,149,012,009.58 | 123,980,076.91 | - | - | 15,494,330.58 | 5,288,486,417.07 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 1,267,363.54 | 1,267,363.54 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 253,472.70 | 253,472.70 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 571,120.80 | 571,120.80 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 96,423.57 | 96,423.57 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 232,430.31 | 232,430.31 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 2,420,810.92 | 2,420,810.92 |
| 利率敏感度缺口 | 5,149,012,009.58 | 123,980,076.91 | - | - | 13,073,519.66 | 5,286,065,606.15 |
| 上年度 | 6个月 | 6个月 | 1-5 | 5年 | 不计息 | 合计 |

| 未 2024 年 12 月 31 日 | 以内 | -1 年 | 年 | 以上 | | |
|-----------------------------|------------------|----------------|---|----|--------------|------------------|
| 资产 | | | | | | |
| 货币资金 | 212,234,891.43 | - | - | - | 228,502.20 | 212,463,393.63 |
| 交易性金融资产 | 2,252,299,347.32 | 130,366,472.60 | - | - | 7,240,533.50 | 2,389,906,353.42 |
| 买入返售金融资产 | 1,597,455,916.18 | - | - | - | 611,364.89 | 1,598,067,281.07 |
| 资产总计 | 4,061,990,154.93 | 130,366,472.60 | - | - | 8,080,400.59 | 4,200,437,028.12 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 621,074.73 | 621,074.73 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 124,214.93 | 124,214.93 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 46,763.01 | 46,763.01 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 47,245.43 | 47,245.43 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 76,379.84 | 76,379.84 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 139,300.00 | 139,300.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 1,054,977.94 | 1,054,977.94 |
| 利率敏感度缺口 | 4,061,990,154.93 | 130,366,472.60 | - | - | 7,025,422.65 | 4,199,382,050.18 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |

| | | |
|------------------|---------------|---------------|
| 1. 市场利率上升 25 个基点 | 2,866,381.67 | 3,416,363.55 |
| 2. 市场利率下降 25 个基点 | -2,863,117.25 | -2,093,411.82 |

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2024 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 | 3,288,696,799.30 | 62.21 | 2,389,906,353.42 | 56.91 |
| 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 | 3,288,696,799.30 | 62.21 | 2,389,906,353.42 | 56.91 |

7.4.13.4.4 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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 3,288,696,799.30 | 2,389,906,353.42 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 3,288,696,799.30 | 2,389,906,353.42 |

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 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。

7.4.14.4 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、买入返售金融资产及应付款项等，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 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。

§ 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 | 3,288,696,799.30 | 62.19 |
| | 其中：债券 | 3,250,643,551.96 | 61.47 |
| | 资产支持证券 | 38,053,247.34 | 0.72 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,996,504,949.26 | 37.75 |
| | 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 | 3,284,668.51 | 0.06 |
| 4 | 其他各项资产 | - | - |
| 5 | 合计 | 5,288,486,417.07 | 100.00 |

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例(%) | |
|----|--------------|--------------|--------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 1.69 | |
| | 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。

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 | 62 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 98 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 38 |

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 | 44.82 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 10.02 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |

| | | | |
|---|------------------------|-------|---|
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 5.86 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 22.48 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 16.58 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.75 | - |

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 | 按实际利率计算的 账面价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 272,103,252.85 | 5.15 |
| | 其中：政策性金融债 | 272,103,252.85 | 5.15 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 966,136,924.37 | 18.28 |
| 6 | 中期票据 | 399,094,355.68 | 7.55 |
| 7 | 同业存单 | 1,613,309,019.06 | 30.52 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 3,250,643,551.96 | 61.49 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

8.6 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) | 按实际利率计算 的账面价值 | 占基金资产净值 比例(%) |
|----|-----------|------------------|-----------|------------------|------------------|
| 1 | 112503280 | 25 农业银行 CD280 | 1,000,000 | 99,744,612.31 | 1.89 |
| 2 | 2504109 | 25 农发贴现 09 | 1,000,000 | 99,572,587.41 | 1.88 |

| | | | | | |
|----|-----------|---------------------|-----------|---------------|------|
| 3 | 112503120 | 25 农业银行 CD120 | 1,000,000 | 99,566,425.89 | 1.88 |
| 4 | 112521128 | 25 渤海银行 CD128 | 1,000,000 | 99,561,522.47 | 1.88 |
| 5 | 112584222 | 25 海南农商 银行 CD015 | 1,000,000 | 99,463,695.97 | 1.88 |
| 6 | 250411 | 25 农发 11 | 900,000 | 91,177,087.78 | 1.72 |
| 7 | 230405 | 23 农发 05 | 500,000 | 51,003,319.47 | 0.96 |
| 8 | 012581633 | 25 杭金投 SCP002 | 500,000 | 50,298,668.59 | 0.95 |
| 9 | 012582641 | 25 知识城 SCP005 | 500,000 | 50,116,654.12 | 0.95 |
| 10 | 112599805 | 25 中信百信 银行 CD015 | 500,000 | 49,953,950.01 | 0.95 |

8.7 “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 | 0.0945% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0231% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0620% |

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名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 按实际利率计算的账面价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 500115 | 金源致远 03A1 | 200,000 | 20,045,650.41 | 0.38 |
| 2 | 266577 | 山财 04A1 | 200,000 | 13,843,490.39 | 0.26 |
| 3 | 265947 | 山财 03A1 | 90,000 | 4,164,106.54 | 0.08 |

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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末无其他资产。

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 |
| 汇添金货币 A | 5,104 | 21,928.24 | 82,188,374.54 | 73.43% | 29,733,366.50 | 26.57% |
| 汇添金货币 B | 88 | 37,322,181.76 | 3,273,872,317.99 | 99.68% | 10,479,676.98 | 0.32% |
| 汇添金货币 C | 757,006 | 2,406.88 | - | - | 1,822,023,652.41 | 100.00% |
| 汇添金货币 D | 1 | 67,768,217.73 | 67,768,217.73 | 100.00% | - | - |
| 汇添金货币 E | - | - | - | - | - | - |
| 合计 | 762,166 | 6,935.58 | 3,423,828,910.26 | 64.77% | 1,862,236,695.89 | 35.23% |

注：期末有 33 名基金份额持有人同时持有汇添金货币 A 份额和汇添金货币 C 份额。

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 | 银行类机构 | 304,145,843.55 | 5.75% |
| 2 | 银行类机构 | 200,064,514.30 | 3.78% |
| 3 | 券商类机构 | 200,064,514.30 | 3.78% |
| 4 | 基金类机构 | 175,049,987.84 | 3.31% |
| 5 | 银行类机构 | 170,662,070.61 | 3.23% |
| 6 | 券商类机构 | 150,006,724.27 | 2.84% |
| 7 | 其他机构 | 103,388,467.19 | 1.96% |
| 8 | 银行类机构 | 100,117,183.82 | 1.89% |
| 9 | 基金类机构 | 100,011,429.08 | 1.89% |
| 10 | 保险类机构 | 80,033,484.29 | 1.51% |

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 | 汇添金货币 A | 11.92 | 0.00% |
| | 汇添金货币 B | 0.00 | 0.00% |
| | 汇添金货币 C | 10,196.64 | 0.00% |
| | 汇添金货币 D | 0.00 | 0.00% |
| | 汇添金货币 E | 0.00 | 0.00% |
| | 合计 | 10,208.56 | 0.00% |

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、基金投资和相关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 |
| | 汇添金货币 E | 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 |
| | 汇添金货币 E | 0 |
| | 合计 | 0 |

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无

§ 10 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 | 汇添金货币 E |
|-------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|---------------|---------|
| 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 | 112,055,879.72 | 4,072,159,477.43 | 0.00 | 15,166,693.03 | 0.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,280,381,309.17 | 24,841,332,489.56 | 29,932,136,190.39 | 55,201,524.70 | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,280,515,447.85 | 25,629,139,972.02 | 28,110,112,537.98 | 2,600,000.00 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 111,921,741.04 | 3,284,351,994.97 | 1,822,023,652.41 | 67,768,217.73 | 0.00 |

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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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：

1、本基金管理人于 2025 年 9 月 6 日发布公告，经管理人股东渤海证券股份有限公司研究决定，免去刘嫣女士公司董事职务，其不再担任公司副董事长职务。

2、本基金管理人于 2025 年 10 月 1 日发布公告，自 2025 年 9 月 30 日起，刘嫣女士担任渤海汇

金证券资产管理有限公司总审计师，公司首席信息官李江先生离任。

3、本基金管理人于 2025 年 10 月 18 日发布公告，管理人股东单位任命齐朝晖、吴国威、麻众志、张建雷、黄立立、高天毅、何青、王延敏、王蓉为公司第四届董事会董事；其中何青、王延敏、王蓉为渤海汇金公司第四届董事会独立董事。

4、本基金管理人于 2025 年 11 月 28 日发布公告，自 2025 年 11 月 26 日起，陆维先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司首席信息官。

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，聘任边济东先生为资产托管部总经理。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

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、本基金托管业务的诉讼。

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

本基金聘请德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为其审计机构。本报告期应支付德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 10,000.00 元。截至本报告期末，该审计机构已为本基金提供审计服务 4 年 3 个月。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚的情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚的情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

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 | - | - | - | - | - |

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，与其签订租用交易单元协议/证券经纪服务协议。

3、本基金本报告期内无新增或退租券商交易单元。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）》的报告期为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日，报告的主要内容为报告期间本公司旗下存续过的所有公募基金通过租用境内证券公司交易单元和委托境内证券公司进行证券投资及佣金支付情况，包括报告期间成立、清算、转型（如有）的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

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 | | 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 | - | - | 524,120,000.00 | 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市场基金调整直销服务大额申购（含大额定期定额投资）业务金额限额的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-01-15 |
| 2 | 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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-01-15 |
| 3 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2025 年春节前暂停申购（含定期定额投资）业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-01-22 |
| 4 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2024 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-01-22 |
| 5 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告的提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-01-22 |
| 6 | 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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-02-05 |
| 7 | 渤海汇金汇添金货币市场基金招募说明书(更新)(2025 年第 1 号) | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-14 |
| 8 | 渤海汇金汇添金货币市场基金（A 类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-14 |
| 9 | 渤海汇金汇添金货币市场基金（B 类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-14 |
| 10 | 渤海汇金汇添金货币市场基金（C 类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-14 |
| 11 | 渤海汇金汇添金货币市场基金（D 类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-14 |
| 12 | 渤海汇金汇添金货币市场基金（E 类份额）基金产品资料概要 | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-14 |

| | | | |
|----|--|-----------|------------|
| | 更新 | | |
| 13 | 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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-14 |
| 14 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度） | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-28 |
| 15 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2024 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-31 |
| 16 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告的提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-31 |
| 17 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2025 年清明节前暂停申购（含定期定额投资）业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-03-31 |
| 18 | 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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-04-07 |
| 19 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下货币基金增加京东肯特瑞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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-04-08 |
| 20 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加江海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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-04-17 |
| 21 | 渤海汇金汇添金货币市场基金恢复部分代销渠道大额申购业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-04-18 |
| 22 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行融联创同业交易平台为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-04-22 |
| 23 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2025 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-04-22 |
| 24 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告的提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-04-22 |
| 25 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 | 中国证监会规定媒介 | 2025-04-22 |

| | | | |
|----|---|-----------|------------|
| | 调整代销机构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 | | |
| 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国融证券作为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-04-25 |
| 27 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2025 年劳动节前暂停申购（含定期定额投资）业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-04-25 |
| 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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-05-06 |
| 29 | 渤海汇金汇添金货币市场基金调整代销机构交通银行股份有限公司大额申购（含大额定期定额投资）业务金额限额的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-05-14 |
| 30 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加麦高证券有限责任公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-05-19 |
| 31 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2025 年端午节前暂停申购（含定期定额投资）业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-05-27 |
| 32 | 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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-06-03 |
| 33 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于民商基金销售（上海）有限公司终止代销旗下基金的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-06-12 |
| 34 | 渤海汇金汇添金货币市场基金调整代销机构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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-06-18 |
| 35 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加华创证券有限责任公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-06-23 |
| 36 | 渤海汇金汇添金货币市场基金调整代销机构北京度小满基金销售有限公司大额申购（含大额 | 中国证监会规定媒介 | 2025-07-15 |

| | | | |
|----|--|-----------|------------|
| | 定期定额投资)业务金额限额的公告 | | |
| 37 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2025 年第 2 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-07-21 |
| 38 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告的提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-07-21 |
| 39 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加南京苏宁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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-07-24 |
| 40 | 渤海汇金汇添金货币市场基金调整代销机构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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-08-15 |
| 41 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2025 年中期报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-08-30 |
| 42 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告的提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-08-30 |
| 43 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于董事会成员调整的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-09-06 |
| 44 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2025 年国庆节前暂停申购(含定期定额投资)业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-09-25 |
| 45 | 渤海汇金证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-10-01 |
| 46 | 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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-10-09 |
| 47 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加福克斯(北京)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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-10-16 |
| 48 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于浦领基金销售有限公司终止代销旗下基金的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-10-16 |
| 49 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-10-18 |
| 50 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 | 中国证监会规定媒介 | 2025-10-28 |

| | | | |
|----|---|-----------|------------|
| | 2025 年第 3 季度报告 | | |
| 51 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告的提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-10-28 |
| 52 | 渤海汇金汇添金货币市场基金调整代销机构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 | 中国证监会规定媒介 | 2025-11-12 |
| 53 | 渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-11-28 |
| 54 | 渤海汇金汇添金货币市场基金调整代销机构珠海盈米基金销售有限公司大额申购（含大额定期定额投资）业务金额限额的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-12-03 |
| 55 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-12-05 |
| 56 | 渤海汇金汇添金货币市场基金调整代销机构上海长量基金销售有限公司大额申购（含大额定期定额投资）业务金额限额的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-12-15 |
| 57 | 渤海汇金汇添金货币市场基金 2026 年元旦前暂停申购（含大额定期定额投资）业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-12-26 |
| 58 | 渤海汇金汇添金货币市场基金调整代销机构通华财富（上海）基金销售有限公司大额申购（含大额定期定额投资）业务金额限额的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-12-30 |

§ 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

注：无。

12.2 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。

§ 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规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.bhhjamc.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
二〇二六年三月三十一日