

渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 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：中泰证券股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。

基金托管人中泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 03 月 23 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	9
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	61

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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金
基金简称	渤海汇金新动能主题混合
场内简称	-
基金主代码	010584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 23 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	中泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	78,334,977.00 份
基金合同存续期	-
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点布局中国新经济产业中基本面良好、具备高成长潜力的优质上市公司，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金为混合型基金，其股票投资比例占基金资产的比例为 60%-95%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将结合国内外宏观经济走势、财政货币政策、证券市场发展趋势等因素，合理的分配股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。</p> <p>(二) 新动能主题界定</p> <p>我国经济发展进入新常态，创新驱动发展战略深入实施，大众创业万众创新蓬勃兴起，以技术创新为引领，以新技术新产业新业态新模式为核心，以知识、技术、信息、数据等新生产要素为支撑的经济发展新动能正在形成。本基金所定义的新动能主题主要涵盖大力开展技术研发，发展新兴产业，扩大中高端有效供给，创造新的经济增长点以对冲传统经济动能减弱的上市公司，以及在传统产业中利用新技术、新业态进行产业改造，减少低端和无效供给，助力产业结构转型升级的上市公司。</p> <p>本基金拟投资的上市公司主要包括：</p> <p>1) 在前沿创新领域如信息技术、智能技术方面投入较大，形成一定行业竞争优势的科技企业，在申银万国一级行业中相关行业包括：电子、计算机、通信、国防军工；</p>

2) 通过发展新型能源、新型材料、新型生产工艺或构造新生产模式, 在传统产业中对排放结构进行绿色化、低碳化、循环化的升级, 或在传统产业中产业结构方面进行高端化、集群化、品牌化、信息化和智能化等转型的企业, 在申银万国一级行业中相关行业包括: 电气设备、机械设备、汽车、有色金属、化工、公用事业;

3) 在包括医疗、教育、文化、娱乐等中高端消费中着力提升消费服务水平, 或利用大数据等手段积极创造新兴业态模式的企业, 在申银万国一级行业中相关的行业包括: 医药生物、传媒、家用电器等。

未来随着科学技术变革和产业结构升级, 本基金界定的新动能主题的范围会发生扩大或者变化, 本基金将在履行适当程序后适时调整上述主题的界定。

(三) 股票投资策略

本基金通过对公司及行业所处的基本面进行深入分析和把握, 结合个股定量指标自下而上的精选新动能主题相关股票构建投资组合。

1、定量分析

本基金将从估值水平、盈利能力、运营质量等定量指标方面对拟投资对象进行评估, 挑选出新动能主题内优质的上市公司股票。

1) 估值水平

本基金结合市场、行业与个股的估值水平来挖掘具备估值优势的上市公司, 可供选择的估值指标包括市盈率 (P/E)、市净率 (P/B)、市盈增长比率 (PEG)、自由现金流贴现 (FCFF, FCFE) 和企业价值 EV/EBITDA 等。

2) 成长性

本基金通过成长性指标分析评估上市公司的历史成长状况, 主要参考的指标包括收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等。

3) 运营质量

本基金通过运营质量指标考察上市公司的内部管理质量, 主要参考的指标包括存货周转率、应收账款周转率、每股经营现金流等。

2、定性分析

本基金在定量分析选取出的股票基础上, 深入研究公司的基本面, 从公司的核心竞争优势、持续成长能力等方面精选上市公司股票, 进行股票组合的构建并适时进行调整。

1) 核心竞争优势。重点考察公司在市场地位、技术研发水平、产品定价能力、资源禀赋、激励制度等方面的特征, 选取具有独特竞争优势的优质企业。

2) 持续成长能力。在对公司未来主营业务收入增长率和净利润增长率分析研判的基础上,选择在较长期限内实现可持续增长的新动能主题上市公司。

(四) 债券投资策略

本基金在保障流动性的基础上,有效利用基金资产进行债券投资,以提高基金资产的投资收益。

首先,通过对国内外宏观经济形势、财政政策、货币政策以及债券市场供求关系等因素的分析,结合基金资产的流动性需求,确定债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排。

其次,在上述约束条件下,综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法,结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素,对个券进行积极的管理。

此外,本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究,通过对转债品种的转股溢价率、纯债溢价率、到期收益率等指标分析,寻找具有债性支撑并且兼具一定股性的品种,捕捉其投资机会。可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票,而是发行人持有的其他上市公司的股票。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

(五) 股指期货、国债期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为目的,参与股指期货的投资。本基金将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,选择流动性较强、交易活跃的期货合约进行空头或多头套期保值,以管理投资组合的系统性风险,提高资金使用效率。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程,确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作,并明确相关岗位职责。此外,基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组,并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

基金管理人可运用国债期货,以提高投资效率。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的投资,以管理投资组合的利率风险,改善组合的风险收益特性。

(六) 资产支持证券投资策略

本基金将通过分析宏观经济等多个因素的研究预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,

	预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时在严格控制风险的情况下，综合运用多个策略和研究方法，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	中泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	麻众志	武书雯
	联系电话	010-68784289	0531-68889449
	电子邮箱	mazz@bhjq.com	wusw@zts.com.cn
客户服务电话		400-651-5988/ 400-651-1717	95538
传真		022-23861651	0531-68889445
注册地址		深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	山东省济南市经七路 86 号
办公地址		深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	山东省济南市经七路 86 号证券大厦 10 楼 1006 室
邮政编码		518054	250001
法定代表人		刘嫣	李峰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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(2021年3月23日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	6,494,233.70
本期利润	16,657,991.39
加权平均基金份额本期利润	0.0964
本期加权平均净值利润率	9.36%
本期基金份额净值增长率	12.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	5,075,240.03
期末可供分配基金份额利润	0.0648
期末基金资产净值	88,135,738.02
期末基金份额净值	1.1251
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	12.51%

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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同于2021年3月23日生效，截至本报告期末成立未满1年，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

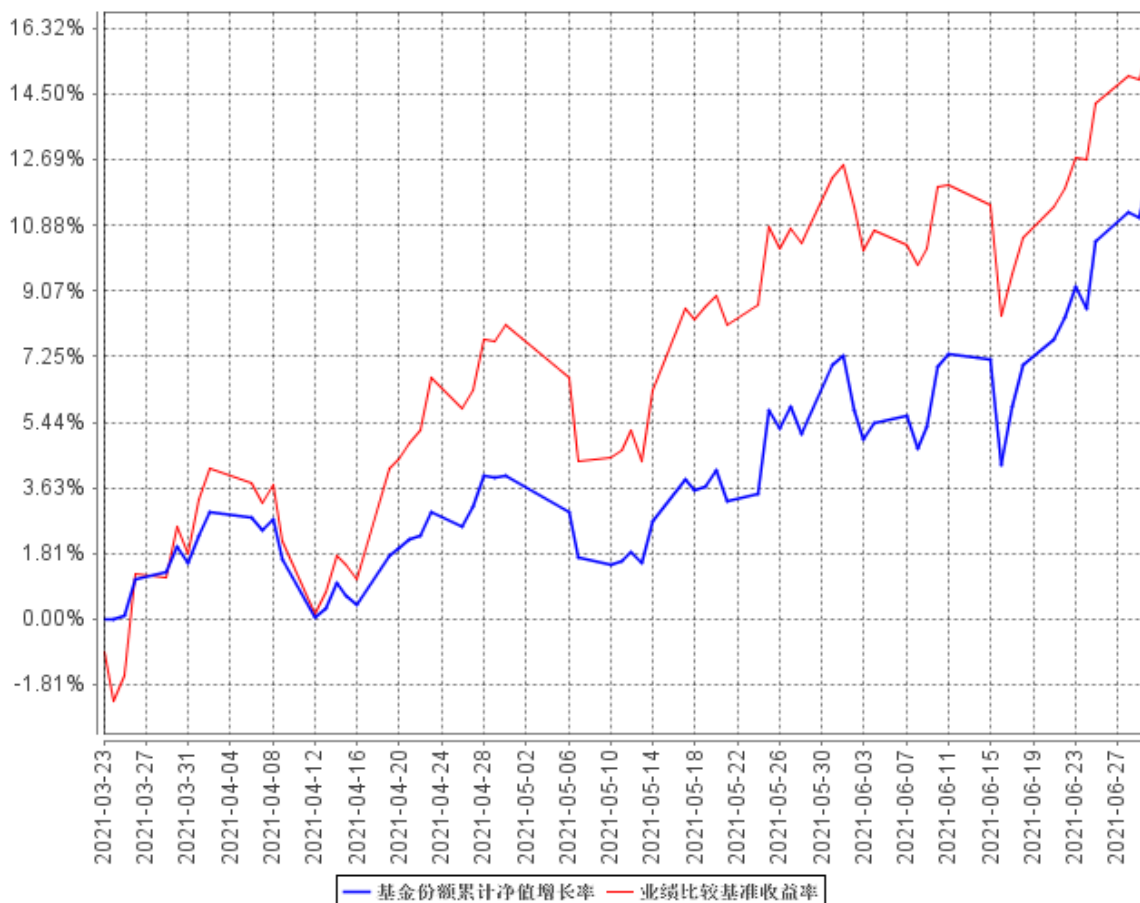
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	5.12%	1.07%	3.26%	0.98%	1.86%	0.09%
过去三个月	10.81%	0.89%	13.81%	1.06%	-3.00%	-0.17%
自基金合同生效起至今	12.51%	0.85%	15.87%	1.10%	-3.36%	-0.25%

注：业绩比较基准：中国战略新兴产业成份指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 3 月 23 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚处于建仓期。

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 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 7 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、渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金、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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何翔	本基金的基金经理、公募投资总监、公募投资部总经理	2021 年 3 月 23 日	-	17 年	南开大学数学学士、金融学硕士。2004 年 2 月至 2013 年 10 月就职于渤海证券研究所，任金融工程部经理。2013 年 10 月至 2016 年 8 月就职于渤海证券基金管理总部，任投资研究部经理。2016 年 8 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任公募投资总监。2017 年 7 月至 2018 年 12 月 10 日担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2018 年 2 月起担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2018 年 7 月起担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。2021 年 3 月起任渤海汇金新动能主题混合型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、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.1.3 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《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》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、投资建议和实时投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对投资指令进行综合平衡，保证交易在各资产组合间的公平执行，保证各类投资人得到公平对待。

4.3.2 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，本基金未发现异常交易行为，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交的单边交易量超过该证券交易当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年 A 股市场先扬后抑，随后震荡上行。春节前各类工业品持续涨价，海内外疫情防控得力，市场盈利预期改善，年初基金发行再创新高共同驱动市场上涨；春节后，通胀担忧加剧，资金流出权重白马股带动市场调整，风险偏好开始下降。进入一季报披露期后，业绩高增的个股受业绩超预期影响开启反弹。五一节后，伴随大宗商品、航运等周期品的加速涨价，周期股在节后引领市场。抱团权重在震荡中寻找合适的估值定位，小市值也在震荡中逐渐回归。具体来看，上半年上证综指、沪深 300、中小 100、创业板指分别上涨 3.40%、0.24%、3.66%、17.22%。

行业方面，电气设备、钢铁、化工相对强势，而家用电器、非银金融、国防军工表现较差。

上半年经济向潜在增长率回归，经济边际放缓是市场的一致预期，但不会出现阶段性快速下行的风险。国内流动性依然保持稳定，美国就业修复趋势的不确定性将持续影响美国的货币政策，进而放大对风险资产的影响。而十四五规划对于创新型经济的支持将长期影响中国经济的转型发展，资本市场的持续制度性改革以及推进国内大循环的政策环境仍从多方面对权益市场形成支持，A 股市场中枢也将继续在震荡中稳步小幅抬升，市场的结构性机会仍将持续。

渤海汇金新动能基金于一季度末发行成立，建仓期为 6 个月。在权益仓位配置上，二季度新动能在严格控制组合风险的基础上稳步提升权益仓位，并随模型信号动态调整仓位大小。行业配置方面，新动能基金作为主题型基金，锚定中国新经济新动能的长期确定性方向，优选消费升级、产业升级、排放结构升级、前沿创新等长期高成长赛道。选股方面，基金主要在新动能主题相关的选股空间内，以多风格多策略量化选股模型为基础配置股票组合，避免了单一策略的周期影响，并定期对选股策略进行再平衡，在长时间维度上获取组合配置带来的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1251 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.51%，业绩比较基准收益率为 15.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，预计市场将维持震荡的格局，操作策略上依然要“重结构、轻指数”。在流动性的靴子落地之后，成长将成为市场的主要动力，持续业绩主导。从时间点来看，中报披露期市场将再次面临业绩的考验，优胜劣汰，预计波动较大，同时预计四季度美国货币政策将会有较为明确的信号，此时市场也将会有大的波动。不过一旦美国货币政策转向的靴子落地，反而会给市场提供更好的长期机会，未来市场主要的驱动力在于业绩增长将更加确定。

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，委员由投资负责人、研究负责人、产品设计负责人、财务负责人、运营保障负责人、风险控制部和法律合规部负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。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。

4.7 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（第十六部分基金的收益与分配中三、基金收益分配原则）的约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守基金合同以及其他有关法规的规定，诚信、尽职地履行了托管人的职责，不存在损害本基金委托人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据相关法规、基金合同的规定对管理人的投资运作等行为进行了监督，对报告期内管理人净值计算、利润分配等方面进行了复核，未发现其存在损害委托人利益的行为。

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

本托管人认真复核了本基金 2021 年中期报告中的财务指标，会计报表、投资组合报告、基金份额变动情况等内容，认为其真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§ 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：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,127,416.77	-
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	68,152,455.82	-
其中：股票投资		68,149,630.12	-
基金投资		-	-
债券投资		2,825.70	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	15,000,037.50	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	945.35	-
应收股利		-	-
应收申购款		804,762.70	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		92,085,618.14	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,817,232.87	-
应付管理人报酬		97,189.07	-
应付托管费		16,198.18	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	19,260.00	-
负债合计		3,949,880.12	-
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	78,334,977.00	-
未分配利润	6.4.7.10	9,800,761.02	-
所有者权益合计		88,135,738.02	-
负债和所有者权益总计		92,085,618.14	-

注：1、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1251 元，基金份额总额 78,334,977.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日，无上一年度可比期间（下同）。

6.2 利润表

会计主体：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 3 月 23 日(基 金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		17,927,938.88	-
1.利息收入		58,343.68	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,422.82	-
债券利息收入		26.24	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,894.62	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,946,937.74	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,591,830.47	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	355,107.27	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,163,757.69	-

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	758,899.77	-
减：二、费用		1,269,947.49	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	582,967.11	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	97,161.17	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	574,934.21	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	14,885.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,657,991.39	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,657,991.39	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	217,088,436.50	-	217,088,436.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,657,991.39	16,657,991.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-138,753,459.50	-6,857,230.37	-145,610,689.87
其中：1. 基金申购款	4,652,000.80	368,387.94	5,020,388.74
2. 基金赎回款	-143,405,460.30	-7,225,618.31	-150,631,078.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少）	-	-	-

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	78,334,977.00	9,800,761.02	88,135,738.02
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

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：

<u>麻众志</u>	<u>赵猛</u>	<u>刘云鹏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金(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[2020]第 2718 号《关于准予渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金注册的批复》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《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》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 216,989,409.82 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2021)第 0307 号验资报告予以验证。经向

中国证监会备案,《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 217,088,436.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 99,026.68 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,基金托管人为中泰证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、政府机构债券、地方政府债券、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的 60-95%,其中投资于本基金界定的“新动能”主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金业绩比较基准:中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2021 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业

会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括应付管理人报酬和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产

与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方

法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一级别的每一基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 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，本基金确定以下类别股票投资和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：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提

供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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行税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	-
定期存款	-
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	8,127,416.77
合计：	8,127,416.77

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	57,985,909.93	68,149,630.12	10,163,720.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,788.20	37.50
	银行间市场	-	-
	合计	2,788.20	37.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	57,988,698.13	68,152,455.82	10,163,757.69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,000,037.50	-
银行间市场	-	-
合计	15,000,037.50	-

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	-
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	910.68
应收结算备付金利息	-

应收债券利息	34.67
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	945.35

注：应收其他存款利息本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金所产生的应收利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6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	-
预提费用	14,085.00
利息红利提前到账	5,175.00
合计	19,260.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	217,088,436.50	217,088,436.50
本期申购	4,652,000.80	4,652,000.80
本期赎回(以“-”号填列)	-143,405,460.30	-143,405,460.30
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	78,334,977.00	78,334,977.00

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,494,233.70	10,163,757.69	16,657,991.39
本期基金份额交易产生的变动数	-1,418,993.67	-5,438,236.70	-6,857,230.37
其中：基金申购款	207,485.70	160,902.24	368,387.94
基金赎回款	-1,626,479.37	-5,599,138.94	-7,225,618.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,075,240.03	4,725,520.99	9,800,761.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年6月30日
活期存款利息收入	1,809.29
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	28,613.53
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	30,422.82

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,591,830.47
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	6,591,830.47

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021 年6月30日
卖出股票成交总额	204,007,517.95
减：卖出股票成本总额	197,415,687.48
买卖股票差价收入	6,591,830.47

6.4.7.12.3 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。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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。

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。

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。

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	355,107.27
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	355,107.27

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	10,163,757.69
——股票投资	10,163,720.19
——债券投资	37.50
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	10,163,757.69

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021 年6月30日
基金赎回费收入	758,899.77
合计	758,899.77

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021 年6月30日
交易所市场交易费用	574,934.21
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	574,934.21

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021 年6月30日
审计费用	14,085.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他费用	800.00
合计	14,885.00

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

截至本报告报出日，本基金无需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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金托管人、基金销售机构、基金证券经纪商
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、基金证券经纪商

注：1、本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月23日(基金合同生效日) 至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
渤海证券	444,052,624.95	96.79%	-	-
中泰证券	14,732,987.18	3.21%		

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至 2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6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	928.80	33.31%	-	-
中泰证券	1,859.40	66.69%		

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至 2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
渤海证券	155,000,000.00	55.98%	-	-
中泰证券	121,900,000.00	44.02%		

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总量的比例
渤海证券	319,598.68	96.69%	-	-
中泰证券	10,936.45	3.31%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总量的比例

-	-	-	-	-
---	---	---	---	---

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	582,967.11	-
其中：支付销售机构的客户维护费	269,121.49	-

注：支付基金管理人渤海汇金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	97,161.17	-

注：支付基金托管人中泰证券的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内无销售服务费。

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：本基金本报告期内未发生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：本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务的重大关联交易事项。

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：无。

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固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
基金合同生效日(2021年3月23日)持有的基金份额	5,001,291.67	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	3,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	2,001,291.67	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.55%	-

注：本基金的申购费率适用于所有基金投资人，赎回费率适用于所有基金份额持有人。

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

注：本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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		上年度可比期间	
	2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
渤海证券	8,002,525.56	26,214.28	-	-
中泰证券	124,891.21	2,399.25	-	-

注：本基金的其他存款为本基金存放于渤海证券、中泰证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

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：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年6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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	49.61	329	3,023.51	16,321.69	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	76.32	201	3,760.71	15,340.32	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	23.23	410	4,961.00	9,524.30	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	34.14	254	3,317.24	8,671.56	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	44.02	175	2,485.00	7,703.50	-

300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	28.81	191	2,811.52	5,502.71	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	32.12	170	1,368.50	5,460.40	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	26.89	200	1,872.00	5,378.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	22.61	218	1,706.94	4,928.98	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	并购重组委召开工作会议，临时停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	15,600	820,862.32	879,060.00	-

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。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建立以董事会为风险管理的最高决策机构，以经营层负责风险管理主体责任，以首席风险官负责风险管理工作具体推动落实，以风险管理委员会为风险管理工作指导机构，由专职的风险控制部门为风险管理的督导执行部门，由管理、支持与保障部门及业务部门、各分支机构为风险管理的具体落实部门的多层级的全面风险管理体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定相应置信程度并计算风险价值，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。本基金的银行存款存放在信用良好的金融机构，与该银行存款相关的信用风险不重大。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流程，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。

本基金的债券投资按债券的存续期限划分为短期债券投资和长期债券投资，存续期限在一年

及一年以内的为短期债券投资，存续期限在一年以上的为长期债券投资。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

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	2,825.70	-
合计	2,825.70	-

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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于开放日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于开放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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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》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，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

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。

本基金的基金管理人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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6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						
银行存款	8,127,416.77	-	-	-	-	8,127,416.77
交易性金融资产	-	-	-	2,825.70	68,149,630.12	68,152,455.82
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	-	15,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	945.35	945.35
应收申购款	-	-	-	-	804,762.70	804,762.70
其他资产	-	-	-	-	37.50	37.50
资产总计	23,127,416.77	-	-	2,825.70	68,955,375.67	92,085,618.14
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	3,817,232.87	3,817,232.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	97,189.07	97,189.07

应付托管费	-	-	-	-	16,198.18	16,198.18
其他负债	-	-	-	-	19,260.00	19,260.00
负债总计	-	-	-	-	3,949,880.12	3,949,880.12
利率敏感度缺口	23,127,416.77	-	-	2,825.70	65,005,495.55	88,135,738.02
上年度末 2020 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						
资产总计	-	-	-	-	-	-
负债						
负债总计	-	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口						

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0032%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	68,149,630.12	77.32	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	68,149,630.12	77.32	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,323,943.06	-
	业绩比较基准下降 5%	-2,323,943.06	-

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§ 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	权益投资	68,149,630.12	74.01
	其中：股票	68,149,630.12	74.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,825.70	0.00
	其中：债券	2,825.70	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	15,000,037.50	16.29
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,127,416.77	8.83
8	其他各项资产	805,708.05	0.87
9	合计	92,085,618.14	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	684,833.20	0.78
B	采矿业	-	-
C	制造业	57,595,943.39	65.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	140,886.00	0.16
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	622,496.00	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,600,145.60	1.82
J	金融业	2,900,974.30	3.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	365,416.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	1,783,124.40	2.02
N	水利、环境和公共设施管理业	16,321.69	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,202,095.10	2.50
R	文化、体育和娱乐业	226,380.00	0.26
S	综合	-	-
	合计	68,149,630.12	77.32

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基股份	30,300	2,691,852.00	3.05
2	603501	韦尔股份	7,400	2,382,800.00	2.70
3	300782	卓胜微	4,140	2,225,250.00	2.52
4	600436	片仔癀	4,800	2,151,840.00	2.44
5	300750	宁德时代	4,000	2,139,200.00	2.43
6	002415	海康威视	28,900	1,864,050.00	2.11
7	603259	药明康德	11,160	1,747,544.40	1.98
8	603486	科沃斯	7,500	1,710,600.00	1.94
9	300122	智飞生物	7,900	1,475,167.00	1.67
10	300059	东方财富	44,480	1,458,499.20	1.65
11	002812	恩捷股份	5,800	1,357,780.00	1.54
12	000661	长春高新	3,500	1,354,500.00	1.54
13	300363	博腾股份	15,900	1,337,508.00	1.52
14	600763	通策医疗	3,200	1,315,200.00	1.49
15	603986	兆易创新	6,780	1,273,962.00	1.45
16	300896	爱美客	1,600	1,262,208.00	1.43
17	002594	比亚迪	5,000	1,255,000.00	1.42
18	002241	歌尔股份	28,200	1,205,268.00	1.37
19	002475	立讯精密	26,200	1,205,200.00	1.37
20	300124	汇川技术	16,200	1,203,012.00	1.36
21	603290	斯达半导	3,600	1,152,000.00	1.31
22	002271	东方雨虹	20,300	1,122,996.00	1.27
23	600276	恒瑞医药	16,500	1,121,505.00	1.27
24	002371	北方华创	3,700	1,026,306.00	1.16
25	688396	华润微	10,500	955,710.00	1.08

26	601208	东材科技	57,300	935,136.00	1.06
27	603008	喜临门	28,100	927,581.00	1.05
28	300014	亿纬锂能	8,800	914,584.00	1.04
29	603737	三棵树	5,160	908,160.00	1.03
30	300015	爱尔眼科	12,495	886,895.10	1.01
31	600460	士兰微	15,600	879,060.00	1.00
32	600036	招商银行	16,200	877,878.00	1.00
33	600031	三一重工	30,000	872,100.00	0.99
34	688981	中芯国际	14,100	871,662.00	0.99
35	002821	凯莱英	2,200	819,720.00	0.93
36	600309	万华化学	7,400	805,268.00	0.91
37	601100	恒立液压	9,200	790,464.00	0.90
38	300450	先导智能	13,120	789,036.80	0.90
39	002230	科大讯飞	11,400	770,412.00	0.87
40	688363	华熙生物	2,700	750,222.00	0.85
41	688012	中微公司	4,500	746,640.00	0.85
42	300474	景嘉微	7,300	714,816.00	0.81
43	002714	牧原股份	11,260	684,833.20	0.78
44	000568	泸州老窖	2,500	589,850.00	0.67
45	600887	伊利股份	15,700	578,231.00	0.66
46	300999	金龙鱼	6,700	569,232.00	0.65
47	688169	石头科技	400	504,400.00	0.57
48	688185	康希诺	600	466,662.00	0.53
49	300595	欧普康视	4,080	422,484.00	0.48
50	600519	贵州茅台	200	411,340.00	0.47
51	300274	阳光电源	3,500	402,710.00	0.46
52	600660	福耀玻璃	6,900	385,365.00	0.44
53	600183	生益科技	15,600	365,196.00	0.41
54	002460	赣锋锂业	2,400	290,616.00	0.33
55	300409	道氏技术	11,600	275,848.00	0.31
56	300748	金力永磁	8,600	272,018.00	0.31
57	600742	一汽富维	26,000	264,940.00	0.30
58	601456	国联证券	17,200	264,880.00	0.30
59	601636	旗滨集团	14,200	263,552.00	0.30
60	600363	联创光电	9,400	261,790.00	0.30
61	300663	科蓝软件	6,800	261,188.00	0.30
62	000012	南玻 A	25,400	260,096.00	0.30
63	002050	三花智控	10,800	258,984.00	0.29
64	002930	宏川智慧	15,800	258,646.00	0.29

65	000049	德赛电池	5,600	257,040.00	0.29
66	601598	中国外运	50,600	255,530.00	0.29
67	600577	精达股份	40,000	255,200.00	0.29
68	002384	东山精密	12,200	254,248.00	0.29
69	600563	法拉电子	1,600	253,376.00	0.29
70	300763	锦浪科技	1,400	252,840.00	0.29
71	002572	索菲亚	10,400	251,680.00	0.29
72	603806	福斯特	2,340	246,004.20	0.28
73	605168	三人行	1,600	245,376.00	0.28
74	603605	珀莱雅	1,200	236,052.00	0.27
75	300413	芒果超媒	3,300	226,380.00	0.26
76	002648	卫星石化	5,600	219,464.00	0.25
77	603185	上机数控	1,200	214,740.00	0.24
78	601865	福莱特	5,400	213,462.00	0.24
79	601633	长城汽车	4,800	209,232.00	0.24
80	600438	通威股份	4,600	199,042.00	0.23
81	600703	三安光电	5,800	185,890.00	0.21
82	600426	华鲁恒升	5,800	179,510.00	0.20
83	000858	五粮液	600	178,734.00	0.20
84	002601	龙蟠佰利	5,000	172,900.00	0.20
85	002414	高德红外	6,000	165,480.00	0.19
86	002706	良信股份	7,250	163,415.00	0.19
87	688111	金山办公	400	157,920.00	0.18
88	002410	广联达	2,200	150,040.00	0.17
89	000001	平安银行	6,600	149,292.00	0.17
90	002311	海大集团	1,800	146,880.00	0.17
91	600900	长江电力	6,600	136,224.00	0.15
92	603638	艾迪精密	3,080	132,039.60	0.15
93	688298	东方生物	600	130,560.00	0.15
94	603267	鸿远电子	1,000	127,920.00	0.15
95	300496	中科创达	800	125,648.00	0.14
96	603129	春风动力	1,000	124,080.00	0.14
97	600406	国电南瑞	5,280	122,707.20	0.14
98	601888	中国中免	400	120,040.00	0.14
99	600690	海尔智家	4,600	119,186.00	0.14
100	601318	中国平安	1,800	115,704.00	0.13
101	000333	美的集团	1,600	114,192.00	0.13
102	002352	顺丰控股	1,600	108,320.00	0.12
103	002028	思源电气	3,100	95,449.00	0.11

104	688036	传音控股	300	62,850.00	0.07
105	300433	蓝思科技	1,800	52,938.00	0.06
106	603392	万泰生物	200	51,836.00	0.06
107	300003	乐普医疗	1,600	51,392.00	0.06
108	300760	迈瑞医疗	100	48,005.00	0.05
109	002030	达安基因	2,080	44,179.20	0.05
110	300676	华大基因	300	35,580.00	0.04
111	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.04
112	605089	味知香	370	32,197.40	0.04
113	000157	中联重科	2,400	22,176.00	0.03
114	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.02
115	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.02
116	605180	华生科技	384	14,208.00	0.02
117	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
118	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
119	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
120	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.01
121	300991	创益通	254	8,671.56	0.01
122	301011	华立科技	175	7,703.50	0.01
123	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.01
124	301012	扬电科技	170	5,460.40	0.01
125	300992	泰福泵业	200	5,378.00	0.01
126	301010	晶雪节能	218	4,928.98	0.01
127	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基股份	6,323,316.00	7.17
2	000661	长春高新	5,769,264.00	6.55
3	603259	药明康德	5,650,472.27	6.41
4	002415	海康威视	5,210,702.00	5.91
5	300122	智飞生物	5,129,889.00	5.82
6	603501	韦尔股份	5,092,073.00	5.78
7	601100	恒立液压	4,926,993.00	5.59

8	002271	东方雨虹	4,776,445.00	5.42
9	300750	宁德时代	4,605,503.00	5.23
10	600436	片仔癀	4,472,803.00	5.07
11	600031	三一重工	4,056,368.00	4.60
12	300760	迈瑞医疗	4,037,230.00	4.58
13	002241	歌尔股份	3,948,783.00	4.48
14	600276	恒瑞医药	3,770,565.00	4.28
15	002475	立讯精密	3,716,433.00	4.22
16	600309	万华化学	3,697,955.00	4.20
17	300059	东方财富	3,660,321.00	4.15
18	300124	汇川技术	3,633,900.00	4.12
19	300015	爱尔眼科	3,297,865.00	3.74
20	300014	亿纬锂能	3,164,267.46	3.59
21	300474	景嘉微	2,286,752.00	2.59
22	300502	新易盛	2,251,093.00	2.55
23	300782	卓胜微	2,238,264.00	2.54
24	300415	伊之密	2,205,777.00	2.50
25	600900	长江电力	2,108,150.00	2.39
26	002311	海大集团	2,107,824.00	2.39
27	603486	科沃斯	2,055,218.00	2.33
28	300413	芒果超媒	1,922,917.00	2.18
29	002142	宁波银行	1,906,470.00	2.16
30	000002	万科 A	1,898,637.00	2.15
31	600183	生益科技	1,897,903.00	2.15
32	600036	招商银行	1,875,072.00	2.13
33	600763	通策医疗	1,869,422.00	2.12

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601012	隆基股份	4,875,236.00	5.53
2	603259	药明康德	4,765,408.20	5.41
3	300760	迈瑞医疗	4,335,039.30	4.92
4	002271	东方雨虹	4,222,617.00	4.79
5	000661	长春高新	4,033,928.00	4.58

6	601100	恒立液压	3,843,718.00	4.36
7	300122	智飞生物	3,757,110.00	4.26
8	002241	歌尔股份	3,680,435.00	4.18
9	300750	宁德时代	3,658,066.00	4.15
10	002415	海康威视	3,620,111.00	4.11
11	600436	片仔癀	3,419,121.00	3.88
12	603501	韦尔股份	3,104,289.34	3.52
13	002475	立讯精密	2,943,667.00	3.34
14	300015	爱尔眼科	2,915,709.00	3.31
15	300059	东方财富	2,854,529.80	3.24
16	600309	万华化学	2,842,140.00	3.22
17	300124	汇川技术	2,826,008.00	3.21
18	600031	三一重工	2,786,821.00	3.16
19	300014	亿纬锂能	2,783,857.00	3.16
20	300502	新易盛	2,515,498.04	2.85
21	600276	恒瑞医药	2,470,122.00	2.80
22	300415	伊之密	2,215,615.00	2.51
23	002311	海大集团	2,039,515.00	2.31
24	002142	宁波银行	1,959,931.00	2.22
25	300413	芒果超媒	1,946,593.60	2.21
26	600900	长江电力	1,867,221.00	2.12

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	255,401,597.41
卖出股票收入（成交）总额	204,007,517.95

注：本项的“买入股票成本(成交)总额”及“卖出股票收入(成交)总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	2,825.70	0.00
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	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,825.70	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019547	16 国债 19	30	2,825.70	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					0.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

无。

7.12.2 本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况

无。

7.12.3 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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	945.35
5	应收申购款	804,762.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	805,708.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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

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
1,657	47,275.18	3,087,214.85	3.94%	75,247,762.15	96.06%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,699,713.17	2.17%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年3月23日）基金份额总额	217,088,436.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,652,000.80
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	143,405,460.30
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	78,334,977.00

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。

§ 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 2021 年 3 月 20 日发布公告，自 2021 年 3 月 19 日起，渤海汇金证券资产管理有限公司的副总经理李耀光先生离任。

2、本基金管理人于 2021 年 4 月 22 日发布公告，自 2021 年 4 月 20 日起，齐朝晖先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的代理党总支书记。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本基金基金托管人重大人事变动：

本基金托管人于 2021 年 3 月 23 日发布公告，托管部高级管理人员进行了调整，聘任韩琛同志为托管部总经理，刘凯同志不再担任托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

无。

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

本报告期内，未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受到稽查或者处罚情况。

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	444,052,624.95	96.79%	319,598.68	96.69%	-
中泰证券	2	14,732,987.18	3.21%	10,936.45	3.31%	-

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、报告的及时性及服务质量；交易佣金收费合理。

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

3、截至本报告期末，本公司作为证券公司子公司于 2020 年上半年方获得上海证券交易所租用其他券商交易单元的资格，已逐步按照公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜，后续将按照监管政策要求完善交易单元租用事宜。

4、本基金本报告期内无新增券商交易单元。

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
渤海证券	928.80	33.31%	155,000,000.00	55.98%	-	-
中泰证券	1,859.40	66.69%	121,900,000.00	44.02%	-	-

10.8 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	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、公司网站	2021 年 2 月 18 日
2	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金产品资料概要	公司网站	2021 年 2 月 18 日
3	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书提示性公告	中国证券报	2021 年 2 月 18 日
4	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书	公司网站	2021 年 2 月 18 日
5	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2021 年 2 月 18 日
6	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同提示性公告	中国证券报	2021 年 2 月 18 日
7	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2021 年 2 月 18 日
8	关于旗下部分基金增加珠海盈米	中国证券报、公司网站	2021 年 2 月 26 日

	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		
9	关于旗下部分基金增加上海利得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	中国证券报、公司网站	2021 年 2 月 26 日
10	关于旗下部分基金增加浙江同花顺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	中国证券报、公司网站	2021 年 2 月 26 日
11	关于旗下渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金开展直销渠道费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 2 月 28 日
12	渤海汇金 关于旗下渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金参与渤海证券股份有限公司分支机构柜台认购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 3 日
13	渤海汇金证券资产管理有限公司关于停止旗下渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金直销渠道、渤海证券分支机构柜台费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 4 日
14	关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金延长募集期的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 12 日
15	关于旗下部分基金参加华瑞保险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	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 17 日
16	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（副总经理）变更公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 20 日
17	关于旗下部分基金在部分三方代销平台开通基金定投业务的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 23 日
18	关于旗下部分基金增加民生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	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 24 日
19	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 24 日
20	2021 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	中国证券报、公司网站	2021 年 4 月 22 日
21	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 5 月 20 日
22	关于旗下部分基金在渤海证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务及参与基金费率优惠活动	中国证券报、公司网站	2021 年 5 月 31 日

	的公告		
23	关于旗下部分基金增加上海万得为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 6 月 28 日

§ 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

本基金报告期内，本基金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新动能主题混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、渤海汇金新动能主题混合型证券投资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：400-651-5988/400-651-1717

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

2021年8月31日