

# 渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>10</b>
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
<b>§4 管理人报告</b>	<b>12</b>
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	15
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
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>17</b>
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18

6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	21
<b>§7 投资组合报告 .....</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	44
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 .....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
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 .....	50
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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 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	45,703,619.98 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: 电力设备、机械设备、汽车、有色金属、基础化工、公用事业、环保;

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

本基金将通过对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	王秀荣
	联系电话	010-68784289	0531-68889484
	电子邮箱	mazz@bhjq.com	wangxr01@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	<a href="https://www.bhhjamc.com">https://www.bhhjamc.com</a>
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(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	-9,121,777.61
本期利润	-7,327,616.21
加权平均基金份额本期利润	-0.1444
本期加权平均净值利润率	-16.15%
本期基金份额净值增长率	-12.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	-3,382,600.27
期末可供分配基金份额利润	-0.0740
期末基金资产净值	42,321,019.71
期末基金份额净值	0.9260
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-7.40%

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。

#### 3.2 基金净值表现

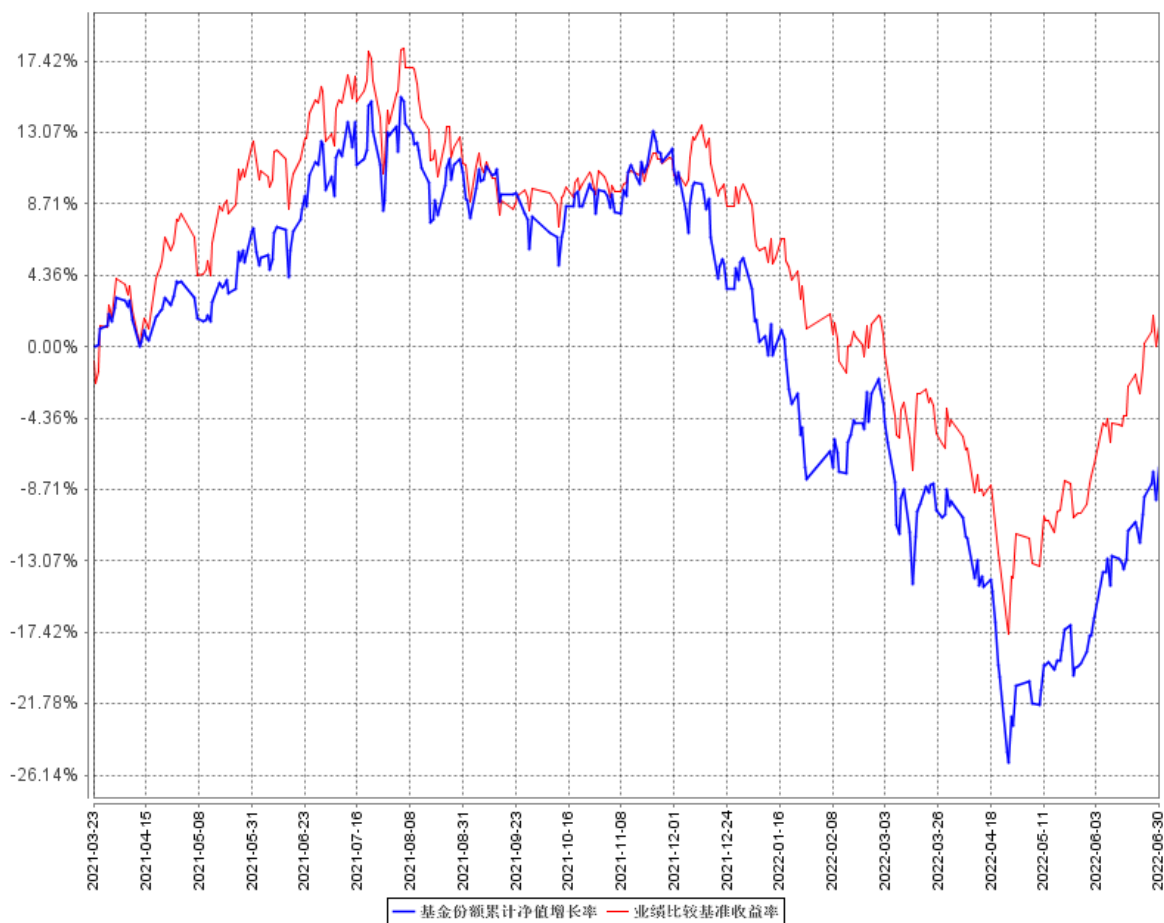
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	12.42%	1.33%	10.51%	1.10%	1.91%	0.23%
过去三个月	2.56%	1.66%	6.51%	1.44%	-3.95%	0.22%
过去六个月	-12.16%	1.60%	-7.85%	1.34%	-4.31%	0.26%
过去一年	-17.70%	1.38%	-12.56%	1.16%	-5.14%	0.22%
自基金合同生效起至今	-7.40%	1.29%	1.31%	1.15%	-8.71%	0.14%

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：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。

### 3.3 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 11 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、渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金、渤海汇金兴宸一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 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	-	18 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。2021 年 12 月 28 日起任渤海汇金量化成长混合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

2022 年上半年，国内国际环境错综复杂。美联储大幅收紧货币阀门令全球市场承压，国际地

缘冲突及国内疫情反复等因素带来的供给及需求冲击超出市场预期。A 股市场在上述因素影响下经历了持续四个月的下跌。5 月之后随着疫情防控形势好转、复工复产的推进以及稳增长政策持续发力，经济指标逐步修复，市场风险偏好有所回升，A 股市场迎来反弹行情。纵观 2022 年上半年，上证指数、沪深 300、创业板指涨跌幅分别为-6.63%、-9.22%、-15.41%。行业方面，仅煤炭行业上涨，其余行业均呈现不同程度下跌，其中电子、计算机、传媒、国防军工跌幅相对较大。

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，努力挖掘基本面优质、成长性较好的标的的超额收益。我们优选消费升级、产业升级、排放结构升级、前沿创新等长期高成长赛道。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，努力避免单一策略的周期影响，并定期对选股策略进行再平衡，以期在长时间维度上获取稳定较好的投资收益。总体来看，一季度配置组合相较基准指数呈现较好的超额收益，但在二季度反弹行情中由于在前期相对抗跌板块上的配置使得二季度反弹阶段落后于基准指数新兴成指的反弹幅度。二季度我们也根据市场变化在量化策略基础上对持仓进行优化调整，努力在持续运作中获得在新动能主题方向下更好的阿尔法收益。

#### 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 0.9260 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.16%，业绩比较基准收益率为-7.85%。

#### 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 2022 年下半年，流动性环境仍保持合理充裕，稳增长政策作用持续发挥有望助推经济弱复苏，四季度将迎来重要会议和政策推出窗口期，在此背景下对于中期市场不宜过度悲观。当然国内经济修复并非一蹴而就，海外需求收缩、地缘冲突演进及疫情变化也将带来扰动。市场上行空间需要等待更多积极因素催化，短期市场将在超跌反弹后演绎震荡分化下的结构性行情，逐渐由情绪修复转向业绩验证。在基金投资思路上我们将继续坚定看好代表中长期产业升级、中国产业链竞争力的经济新动能方向，在新动能主题相关的行业中，重点关注持续高景气度且盈利增速稳定的成长细分领域，受益于政策支持、具备估值优势的稳增长方向以及疫情好转预期下消费方向的边际修复机会。下半年在过于拥挤的部分方向上，由于存在短期估值消化的需要，涨势或者趋缓，或者进入震荡阶段，机会则会向景气产业链的纵深方向发展。一些此前关注度相对较少，且估值又具备一定相对优势的景气方向细分领域，可能会在下半年有产生超额收益的好机会，所以下半年可以向纵深去挖掘细分领域的中小成长类股票。同时根据市场环境变化对策略及组合配置进行不断优化调整，努力持续挖掘出新动能主题方向下的阿尔法收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，估值委员会成员由公司总经理、分管投资部门的高级管理人员、公募投资部门负责人、财务负责人、产品部及研究部负责人等人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。公募投资部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同（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 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况。本基金自 2022 年 1 月 20 日至 2022 年 4 月 5 日连续 47 个工作日，以及 2022 年 4 月 11 日至 2022 年 6 月 20 日连续 47 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。

## § 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，本基金托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

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的规定、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人的投资运作进行了监督，对基金净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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，认为其真实、准确和完整。



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,817,826.46	4,017,224.88
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	39,422,596.31	47,838,399.30
其中：股票投资		39,390,237.40	47,809,528.70
基金投资		-	-
债券投资		32,358.91	28,870.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	2,000,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		203,126.37	163,081.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-41.45
资产总计		42,443,549.14	54,018,664.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		24,163.09	112,156.61
应付管理人报酬		41,809.45	53,627.56
应付托管费		6,968.26	8,937.96
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.06	0.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	49,588.57	40,000.00
负债合计		122,529.43	214,722.44
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	45,703,619.98	51,035,702.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-3,382,600.27	2,768,239.67
净资产合计		42,321,019.71	53,803,941.67
负债和净资产总计		42,443,549.14	54,018,664.11

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9260 元，基金份额总额 45,703,619.98 份。

## 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	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
<b>一、营业总收入</b>		-6,962,694.58	17,927,938.88
1.利息收入		9,321.29	58,343.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,027.73	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		1,293.56	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）		-8,975,005.39	6,946,937.74
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-9,392,436.62	6,591,830.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	76.59	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	417,354.64	355,107.27

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,794,161.40	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）	6.4.7.21	208,828.12	758,899.77
<b>减：二、营业总支出</b>		364,921.63	1,269,947.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	270,284.65	582,967.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,047.38	97,161.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.03	-
8. 其他费用	6.4.7.23	49,589.57	589,819.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-7,327,616.21	16,657,991.39
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-7,327,616.21	16,657,991.39
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-7,327,616.21	16,657,991.39

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	51,035,702.00	-	2,768,239.67	53,803,941.67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基	51,035,702.00	-	2,768,239.67	53,803,941.67

金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,332,082.02	-	-6,150,839.94	-11,482,921.96
(一)、综合收益总额	-	-	-7,327,616.21	-7,327,616.21
(二)、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)	-5,332,082.02	-	1,176,776.27	-4,155,305.75
其中: 1.基金申购款	24,602,355.24	-	-2,229,891.43	22,372,463.81
2.基金赎回款	-29,934,437.26	-	3,406,667.70	-26,527,769.56
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	45,703,619.98	-	-3,382,600.27	42,321,019.71
项目	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			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	217,088,436.50	-	-	217,088,436.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-138,753,459.50	-	9,800,761.02	-128,952,698.48
(一)、综合收益总额	-	-	16,657,991.39	16,657,991.39
(二)、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
(三)、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	-	-	-	-



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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告不一致，具体请见会计政策变更的说明。

#### 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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则，并采

用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”适用于以摊余成本计量的金融资产。“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。

本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息项目或应付利息”项目。

#### 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[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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
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	2,817,826.46
等于：本金	2,816,622.22
加：应计利息	1,204.24
减：坏账准备	—
合计：	2,817,826.46

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 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	37,063,289.54	-	39,390,237.40	2,326,947.86	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	25,788.20	70.61	32,358.91	6,500.10
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	25,788.20	70.61	32,358.91	6,500.10
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	37,089,077.74	70.61	39,422,596.31	2,333,447.96	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 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。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末未持有其他债权。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：无。

**6.4.7.8 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	49,588.57
合计	49,588.57

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	51,035,702.00	51,035,702.00
本期申购	24,602,355.24	24,602,355.24
本期赎回(以“-”号填列)	-29,934,437.26	-29,934,437.26
- 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	45,703,619.98	45,703,619.98

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 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
本期期初	8,271,290.84	-5,503,051.17	2,768,239.67
本期利润	-9,121,777.61	1,794,161.40	-7,327,616.21
本期基金份额交易产生的变动数	382,900.92	793,875.35	1,176,776.27
其中：基金申购款	966,975.13	-3,196,866.56	-2,229,891.43
基金赎回款	-584,074.21	3,990,741.91	3,406,667.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-467,585.85	-2,915,014.42	-3,382,600.27

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,027.60
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	8,027.73

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。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,392,436.62
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	-9,392,436.62

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	157,020,241.07
减：卖出股票成本总额	166,003,393.39
减：交易费用	409,284.30
买卖股票差价收入	-9,392,436.62

##### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	76.59
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	76.59

#### 6.4.7.15.2 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。

#### 6.4.7.15.3 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。

#### 6.4.7.15.4 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。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 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。

##### 6.4.7.17.2 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。

##### 6.4.7.17.3 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。

##### 6.4.7.17.4 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。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 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。

## 6.4.7.18.2 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。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	417,354.64
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	417,354.64

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	1,794,161.40
——股票投资	1,796,743.70
——债券投资	-2,582.30
——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	1,794,161.40

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	208,828.12

合计	208,828.12
----	------------

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1.00
其他费用	-
合计	49,589.57

#### 6.4.7.24 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 2022年1月1日至2022年6月30日		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	
	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	309,829,204.93	99.06%	444,052,624.95	96.79%
中泰证券	2,955,657.20	0.94%	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 2022年1月1日至2022年6月30日		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	
	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 2022年1月1日至2022年6月30日		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	
	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	3,000,000.00	100.00%	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 2022年1月1日至2022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	占期末应付佣金总额的比例
渤海证券	223,740.40	99.05%	-	-
中泰证券	2,137.28	0.95%	-	-
关联方名称	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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
渤海证券	319,598.68	96.69%	-	-
中泰证券	10,936.45	3.31%	-	-

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 2022年1月1日至2022年6月30日	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
	当期发生的基金应支付的管理费	270,284.65
其中：支付销售机构的客户维护费	124,973.05	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 2022年1月1日至2022年6月30日	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
当期发生的基金应支付的托管费	45,047.38	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 2022年1月1日至2022年6月30日	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
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	1,301,291.67	-
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	1,301,291.67	2,001,291.67
报告期末持有的基金份额	2.85%	2.55%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：基金管理人投资本基金适用的认（申）购/赎回费按本基金基金合同和招募说明书规定执行。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
渤海证券-其他存款	1,929,704.29	6,261.00	8,002,525.56	26,214.28
中泰证券-其他存款	888,122.17	1,766.60	124,891.21	2,399.25
中泰证券-活期存款	-	0.13	-	1,809.29

注：1、本基金的活期银行存款由基金托管人中泰证券保管，按银行同业利率计息。

2、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（2022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	受限期	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
600941	中国	2021年	6个	新股	57.58	60.23	30,380	1,749,280.40	1,829,787.40	-

	移动	12月24	月	流通						
		日		受限						

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事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

本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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了以董事会为风险管理的最高决策机构，以经营层负责风险管理主体责任，以首席风险官负责风险管理工作具体推动落实，以风险管理委员会为风险管理工作指导机构，由专职的风险控制部门为风险管理的督导执行部门，由管理、支持与保障部门及业务部门、各分支机构为风险管理的具体落实部门，由稽核部门为风险管理的督导审计部门的多层级的全面风险管理体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人，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主要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，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	8,277.46	-
AAA 以下	21,093.88	25,866.70
未评级	2,987.57	3,003.90
合计	32,358.91	28,870.60

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 2022 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%。本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期。

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。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。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	2,817,826.46	-	-	-	-	2,817,826.46
交易性金融资产	-	-	-	32,358.91	39,390,237.40	39,422,596.31
应收申购款	-	-	-	-	203,126.37	203,126.37
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,817,826.46	-	-	32,358.91	39,593,363.77	42,443,549.14
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	24,163.09	24,163.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	41,809.45	41,809.45
应付托管费	-	-	-	-	6,968.26	6,968.26
应交税费	-	-	-	-	0.06	0.06
其他负债	-	-	-	-	49,588.57	49,588.57
负债总计	-	-	-	-	122,529.43	122,529.43
利率敏感度缺口	2,817,826.46	-	-	32,358.91	39,470,834.34	42,321,019.71
上年度末 2021年12月31日	6个月以内	6个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						



银行存款	4,017,224.88	-	-	-	-	4,017,224.88
交易性金融资产	-	-	-	28,870.60	47,809,528.70	47,838,399.30
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	-	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-41.45	-41.45
应收申购款	-	-	-	-	163,081.38	163,081.38
-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,017,224.88	-	-	28,870.60	47,972,568.63	54,018,664.11
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	112,156.61	112,156.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	53,627.56	53,627.56
应付托管费	-	-	-	-	8,937.96	8,937.96
应交税费	-	-	-	-	0.31	0.31
其他负债	-	-	-	-	40,000.00	40,000.00
负债总计	-	-	-	-	214,722.44	214,722.44
利率敏感度缺口	6,017,224.88	-	-	28,870.60	47,757,846.19	53,803,941.67

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-512.52	4,878.47
	市场利率下降 25 个基点	525.42	-4,871.74

#### 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 2022年6月30日		上年度末 2021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	39,390,237.40	93.07	47,809,528.70	88.86
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	39,390,237.40	93.07	47,809,528.70	88.86

#### 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	1,500,339.67	1,657,322.11
	业绩比较基准下降5%	-1,500,339.67	-1,657,322.11

#### 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 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	37,560,450.00	45,306,126.66
第二层次	32,358.91	28,870.60
第三层次	1,829,787.40	2,503,402.04
合计	39,422,596.31	47,838,399.30

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

### 6.4.15 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	39,390,237.40	92.81
	其中：股票	39,390,237.40	92.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,358.91	0.08
	其中：债券	32,358.91	0.08
	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	-	-
	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	2,817,826.46	6.64
8	其他各项资产	203,126.37	0.48
9	合计	42,443,549.14	100.00

### 7.2 报告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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,178,938.00	66.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,191,524.00	5.18
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,738,407.40	8.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,037,375.00	7.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,243,993.00	5.30
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,390,237.40	93.07

### 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	600941	中国移动	30,380	1,829,787.40	4.32
2	600763	通策医疗	7,500	1,308,300.00	3.09
3	300347	泰格医药	9,900	1,133,055.00	2.68
4	300613	富瀚微	11,500	975,200.00	2.30
5	000498	山东路桥	99,600	962,136.00	2.27
6	603185	上机数控	6,100	951,539.00	2.25
7	300015	爱尔眼科	20,900	935,693.00	2.21
8	688385	复旦微电	14,200	925,698.00	2.19
9	000661	长春高新	3,900	910,338.00	2.15
10	300775	三角防务	18,700	900,405.00	2.13
11	300037	新宙邦	17,060	896,673.60	2.12
12	601668	中国建筑	165,900	882,588.00	2.09
13	300357	我武生物	16,900	879,307.00	2.08
14	300390	天华超净	10,000	874,000.00	2.07
15	002460	赣锋锂业	5,800	862,460.00	2.04
16	600438	通威股份	14,400	861,984.00	2.04
17	601012	隆基绿能	12,900	859,527.00	2.03
18	600436	片仔癀	2,400	856,152.00	2.02
19	603659	璞泰来	10,100	852,440.00	2.01
20	002709	天赐材料	13,700	850,222.00	2.01
21	300316	晶盛机电	12,200	824,598.00	1.95
22	603290	斯达半导	2,100	810,390.00	1.91
23	002812	恩捷股份	3,200	801,440.00	1.89
24	002920	德赛西威	5,300	784,400.00	1.85
25	002007	华兰生物	34,200	779,760.00	1.84

26	603259	药明康德	7,160	744,568.40	1.76
27	300759	康龙化成	7,750	737,955.00	1.74
28	000733	振华科技	5,400	734,238.00	1.73
29	002821	凯莱英	2,300	664,700.00	1.57
30	002594	比亚迪	1,900	633,631.00	1.50
31	002801	微光股份	20,800	620,880.00	1.47
32	600141	兴发集团	14,100	620,259.00	1.47
33	002459	晶澳科技	7,700	607,530.00	1.44
34	000519	中兵红箭	20,500	597,575.00	1.41
35	688516	奥特维	2,200	587,290.00	1.39
36	002410	广联达	10,000	544,400.00	1.29
37	688033	天宜上佳	25,600	543,744.00	1.28
38	688005	容百科技	4,200	543,648.00	1.28
39	300750	宁德时代	1,000	534,000.00	1.26
40	600760	中航沈飞	8,500	513,825.00	1.21
41	688668	鼎通科技	7,200	506,448.00	1.20
42	300829	金丹科技	11,500	372,830.00	0.88
43	601789	宁波建工	60,000	346,800.00	0.82
44	300763	锦浪科技	1,400	298,200.00	0.70
45	688202	美迪西	860	292,064.60	0.69
46	300014	亿纬锂能	2,900	282,750.00	0.67
47	002129	中环股份	4,500	265,005.00	0.63
48	300122	智飞生物	2,200	244,222.00	0.58
49	688598	金博股份	800	235,760.00	0.56
50	603392	万泰生物	1,515	235,279.50	0.56
51	300601	康泰生物	5,080	229,514.40	0.54
52	300661	圣邦股份	1,200	218,424.00	0.52
53	603267	鸿远电子	1,600	214,928.00	0.51
54	300628	亿联网络	2,800	213,220.00	0.50
55	601633	长城汽车	5,400	200,016.00	0.47
56	000831	五矿稀土	6,400	200,000.00	0.47
57	002648	卫星化学	7,700	199,045.00	0.47
58	688111	金山办公	1,000	197,120.00	0.47
59	688099	晶晨股份	1,900	191,900.00	0.45
60	688036	传音控股	2,150	191,844.50	0.45
61	002241	歌尔股份	5,600	188,160.00	0.44
62	688169	石头科技	300	185,010.00	0.44
63	600111	北方稀土	5,200	182,832.00	0.43
64	688298	东方生物	1,580	180,357.00	0.43

65	300595	欧普康视	3,100	177,289.00	0.42
66	300760	迈瑞医疗	500	156,600.00	0.37
67	603127	昭衍新药	1,140	129,732.00	0.31
68	600276	恒瑞医药	2,100	77,889.00	0.18
69	603456	九洲药业	1,400	72,380.00	0.17
70	300725	药石科技	600	59,394.00	0.14
71	600196	复星医药	1,300	57,317.00	0.14
72	002603	以岭药业	1,900	46,170.00	0.11
73	300158	振东制药	800	5,400.00	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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002812	恩捷股份	2,878,706.00	5.35
2	300347	泰格医药	2,122,128.00	3.94
3	002460	赣锋锂业	2,007,340.00	3.73
4	300750	宁德时代	1,922,682.00	3.57
5	600763	通策医疗	1,907,882.09	3.55
6	300014	亿纬锂能	1,857,714.00	3.45
7	600438	通威股份	1,828,994.00	3.40
8	600900	长江电力	1,824,819.00	3.39
9	603659	璞泰来	1,756,947.00	3.27
10	603259	药明康德	1,620,277.00	3.01
11	300037	新宙邦	1,577,188.40	2.93
12	300759	康龙化成	1,499,679.00	2.79
13	600141	兴发集团	1,490,850.00	2.77
14	300390	天华超净	1,485,378.00	2.76
15	002821	凯莱英	1,402,896.00	2.61
16	300316	晶盛机电	1,333,241.00	2.48
17	600436	片仔癀	1,323,184.81	2.46
18	000661	长春高新	1,308,368.00	2.43
19	688033	天宜上佳	1,300,775.45	2.42
20	002648	卫星化学	1,281,477.00	2.38
21	300274	阳光电源	1,251,124.00	2.33

22	002709	天赐材料	1,210,425.00	2.25
23	603392	万泰生物	1,167,542.00	2.17
24	002007	华兰生物	1,166,094.10	2.17
25	300782	卓胜微	1,147,810.00	2.13
26	603127	昭衍新药	1,147,724.00	2.13
27	688516	奥特维	1,138,355.77	2.12
28	300015	爱尔眼科	1,108,483.00	2.06
29	300601	康泰生物	1,102,778.80	2.05
30	601012	隆基绿能	1,098,952.00	2.04
31	688668	鼎通科技	1,088,775.74	2.02
32	002920	德赛西威	1,087,125.00	2.02
33	601668	中国建筑	1,085,298.00	2.02
34	603290	斯达半导	1,084,120.00	2.01

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002812	恩捷股份	2,803,630.00	5.21
2	600900	长江电力	2,315,379.00	4.30
3	300014	亿纬锂能	2,004,832.00	3.73
4	300750	宁德时代	1,708,540.00	3.18
5	300124	汇川技术	1,599,484.00	2.97
6	603290	斯达半导	1,546,007.00	2.87
7	300274	阳光电源	1,500,685.00	2.79
8	300782	卓胜微	1,387,948.01	2.58
9	603259	药明康德	1,337,973.60	2.49
10	002594	比亚迪	1,328,715.00	2.47
11	002460	赣锋锂业	1,274,938.00	2.37
12	603392	万泰生物	1,254,618.00	2.33
13	002821	凯莱英	1,220,291.00	2.27
14	300347	泰格医药	1,218,222.00	2.26
15	603501	韦尔股份	1,202,885.00	2.24
16	603127	昭衍新药	1,195,308.00	2.22
17	600438	通威股份	1,160,846.00	2.16
18	300759	康龙化成	1,159,496.00	2.16



19	300059	东方财富	1,094,479.80	2.03
20	601899	紫金矿业	1,067,273.00	1.98

### 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	155,787,358.39
卖出股票收入（成交）总额	157,020,241.07

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	2,987.57	0.01
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）	29,371.34	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,358.91	0.08

### 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	123127	耐普转债	100	12,783.48	0.03
2	113633	科沃转债	70	8,310.40	0.02
3	113053	隆 22 转债	60	8,277.46	0.02
4	019547	16 国债 19	30	2,987.57	0.01

### 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 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 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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	203,126.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,126.37

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	------	---------

				比例 (%)
1	123127	耐普转债	12,783.48	0.03
2	113633	科沃转债	8,310.40	0.02

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600941	中国移动	1,829,787.40	4.32	新股锁定

### 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
974	46,923.63	2,496,164.07	5.46%	43,207,455.91	94.54%

### 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	2,208,600.09	4.83%

### 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## § 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
本报告期期初基金份额总额	51,035,702.00
本报告期基金总申购份额	24,602,355.24
减：本报告期基金总赎回份额	29,934,437.26
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	45,703,619.98

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 2022 年 01 月 01 日发布公告，自 2021 年 12 月 31 日起，魏文婷女士担任渤海汇金证券资产管理有限公司的总经理助理，原副总经理王琦先生离任。

2、本基金管理人于 2022 年 01 月 11 日发布公告，决定将渤海证券股份有限公司派驻渤海汇金证券资产管理有限公司的董事徐海军同志变更为方超同志。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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的情况。

### 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	309,829,204.93	99.06%	223,740.40	99.05%	-
中泰证券	2	2,955,657.20	0.94%	2,137.28	0.95%	-

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	-	-	3,000,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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	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	公司网站、中国证券报	2022 年 1 月 1 日
2	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	公司网站	2022 年 1 月 1 日
3	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报	2022 年 1 月 4 日
4	关于渤海汇金证券资产管理有限公司董事会成员变更的公告	公司网站	2022 年 1 月 11 日
5	关于渤海汇金证券资产管理有限公司董事会成员变更的公告	中国证券报	2022 年 1 月 12 日
6	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021 年第 2 号）	公司网站	2022 年 1 月 21 日

7	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（更新）	公司网站	2022 年 1 月 21 日
8	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书（更新）及基金产品资料概要（更新）提示性公告	中国证券报	2022 年 1 月 21 日
9	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站	2022 年 1 月 24 日
10	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 4 季度报告的提示性公告	中国证券报	2022 年 1 月 24 日
11	关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	公司网站、中国证券报	2022 年 3 月 10 日
12	渤海汇金证券资产管理有限公司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	公司网站、中国证券报	2022 年 3 月 21 日
13	关于旗下部分基金增加北京中植基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 3 月 23 日
14	关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	公司网站、中国证券报	2022 年 3 月 24 日
15	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站	2022 年 3 月 31 日
16	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告的提示性公告	中国证券报	2022 年 3 月 31 日
17	关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	公司网站、中国证券报	2022 年 3 月 31 日
18	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站	2022 年 4 月 22 日
19	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证券报	2022 年 4 月 22 日
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北京创金启富基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 12 日
21	关于渤海汇金新动能主题混合型	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 26 日



	证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告		
22	渤海汇金证券资产管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 30 日
23	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 31 日
24	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加中正达广基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 31 日
25	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加洪泰财富（青岛）基金销售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	公司网站、中国证券报	2022 年 6 月 2 日
26	关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	公司网站、中国证券报	2022 年 6 月 10 日
27	渤海汇金证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 6 月 15 日
28	渤海汇金证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	公司网站、中国证券报	2022 年 6 月 16 日
29	渤海汇金证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	公司网站、中国证券报	2022 年 6 月 17 日
30	关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	公司网站、中国证券报	2022 年 6 月 17 日
31	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金更新代销机构洪泰财富（青岛）基金销售有限	公司网站、中国证券报	2022 年 6 月 28 日

---

	责任公司相关信息的公告		
--	-------------	--	--

## § 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

2022 年 8 月 31 日