

# 渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券 投资基金 2021 年年度报告

2021 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经董事会审议，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 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。

本报告期为 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	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遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
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	17
<b>§5 托管人报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	18
<b>§6 审计报告</b>	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>22</b>
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
<b>§8 投资组合报告</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

8.6	期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	53
8.7	期末按摊余成本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
8.8	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
8.9	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
8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
8.11	投资组合报告附注 .....	54
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
9.3	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
9.4	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
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	58
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
11.8	其他重大事件 .....	59
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
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
<b>§13</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
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	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券
场内简称	-
基金主代码	009836
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 10 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	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,000,263,574.27 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	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>（1）封闭期配置策略</p> <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。</p> <p>基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。</p> <p>（2）债券类金融工具类属配置策略</p> <p>类属配置是指对各市场及各种类的债券类金融工具之间进行类属配置，构建最能符合本基金风险收益特征的资产组合。具体包括市场配置和品种选择两个层面。在市场配置层面，本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据交易所市场和银行间市场等市场债券类金融工具的到期收益率变化、流动性变化和市场规模等情况，确定不同市场中债券类金融工具所占的投资比例。</p> <p>在品种选择层面，本基金将基于各品种债券类金融工</p>

	<p>具收益率水平、宏观经济预测分析以及税收因素的影响，综合考虑流动性、收益性等因素，采取定量分析和定性分析结合的方法，在各种债券类金融工具之间进行优化配置。</p> <p>(3) 信用债投资策略</p> <p>本基金由于封闭期内采用买入持有到期投资策略，因此，个券精选是本基金投资策略的重要组成部分。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源。本基金将采用内外结合的信用研究和评级制度，根据对宏观经济形势、发行人公司所在行业状况、以及公司自身在行业内的竞争力、公司财务状况和现金流状况、公司治理等信息，进一步结合债券发行具体条款对债券进行分析，评估信用风险溢价，发掘具备相对价值的个券。</p> <p>为控制本基金的信用风险，本基金所投资的信用债等级均为 AAA 及以上，即 AAA 及以上评级信用债占信用债投资比例的 100%，并将定期对所投债券的信用资质和发行人的偿付能力进行评估。对于存在信用风险隐患的发行人所发行的债券，及时制定风险处置预案。封闭期内，如本基金持有债券的信用风险显著增加时，为减少信用损失，本基金将对该债券进行处置。</p> <p>(4) 杠杆投资策略</p> <p>本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。本基金将在封闭期内进行杠杆投资，杠杆放大部分仍投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，并采取买入持有到期投资策略。同时采取滚动回购的方式来维持杠杆，因此负债的资金成本存在一定的波动性。</p> <p>(5) 资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>(6) 封闭期现金管理策略</p> <p>在每个封闭期内完成组合的构建之前，本基金将根据届时的市场环境对组合的现金头寸进行管理，选择到期日（或回售日）在建仓期之内的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资，并采用买入持有到期投资策略。</p> <p>由于在建仓期本基金的投资难以做到与封闭期剩余期限完美匹配，因此可能存在持有的部分投资品种在封</p>
--	--

	<p>闭期结束前到期兑付本息的情形。另一方面，本基金持有的部分投资品种的付息也将增加基金的现金头寸。对于现金头寸，本基金将根据届时的市场环境和封闭期剩余期限，选择到期日（或回售日）在封闭期结束之前的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资或进行基金现金分红。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准	<p>本基金的业绩比较基准为封闭期起始日中国人民银行公布的银行三年期定期存款利率（税后）+1%</p> <p>银行三年期定期存款利率为中国人民银行公布并执行的金融机构人民币三年期定期存款利率，具有较强的权威性和市场影响力。</p>
风险收益特征	<p>本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。</p>

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	麻众志
	联系电话	010-68784289
	电子邮箱	mazz@bhzq.com
客户服务电话	400-651-5988/ 400-651-1717	95561
传真	022-23861651	021-62159217
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	福州市湖东路 154 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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	518054	200120
法定代表人	刘嫣	吕家进

## 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	<a href="https://www.bhhjamc.com">https://www.bhhjamc.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 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	天津市南开区宾水西道 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	2021 年	2020 年 11 月 10 日 (基金合同生效 日)-2020 年 12 月 31 日	2019 年
本期已实现收益	319,364,470.90	35,948,303.16	-
本期利润	319,364,470.90	35,948,303.16	-
加权平均基金份额本期利润	0.0399	0.0045	-
本期加权平均净值利润率	3.91%	0.45%	-
本期基金份额净值增长率	3.99%	0.45%	-
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	32,102,126.05	35,948,303.16	-
期末可供分配基金份额利润	0.0040	0.0045	-
期末基金资产净值	8,032,365,700.32	8,036,211,877.43	-
期末基金份额净值	1.0040	1.0045	-
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	4.45%	0.45%	-

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

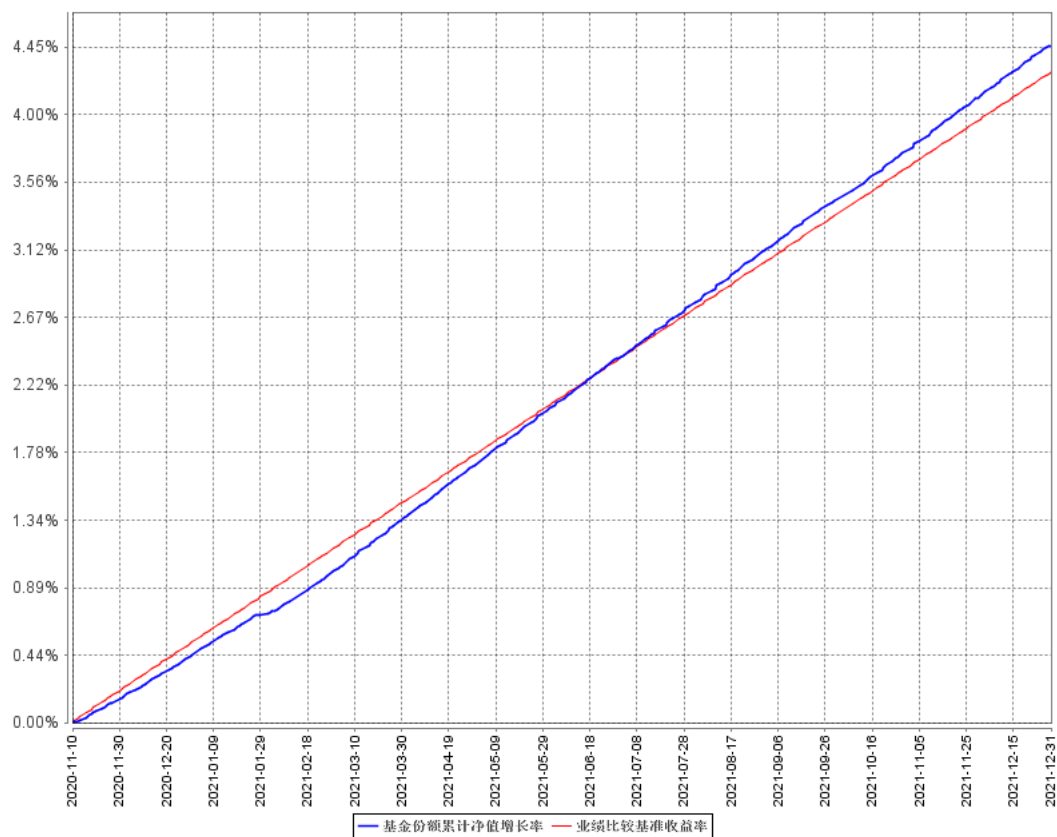
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.98%	0.01%	0.91%	0.01%	0.07%	0.00%
过去六个月	2.01%	0.01%	1.85%	0.01%	0.16%	0.00%
过去一年	3.99%	0.01%	3.73%	0.01%	0.26%	0.00%
自基金合同 生效起至今	4.45%	0.01%	4.28%	0.01%	0.17%	0.00%

注：业绩比较基准：封闭期起始日中国人民银行公布的银行三年期定期存款利率（税后）+1%

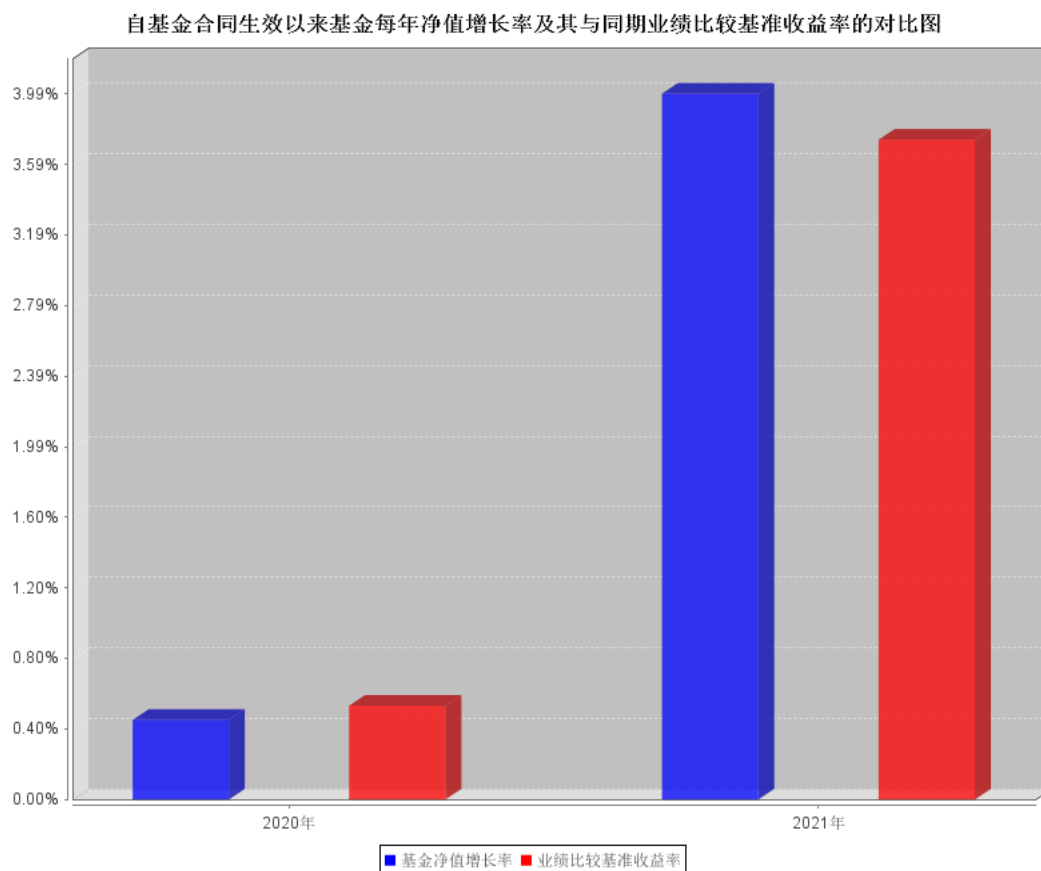
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于 2020 年 11 月 10 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2021	0.404	323,210,648.01	-	323,210,648.01	
2020	-	-	-	-	
合计	0.404	323,210,648.01	-	323,210,648.01	

## § 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 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 10 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。

#### 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		
李杨	本基金的基金经理	2020 年 11 月 10 日	-	5 年	天津财经大学经济学学士。2011 年 10 月到 2014 年 4 月，在包商银行股份有限公司任债券交易员，2014 年 5 月到 2016 年 8 月，在天津银行股份有限公司任债券交易员，2016 年 9 月至今，在渤海汇金证券资产管理有限公司任基金经理。2017 年 8 月至 2021 年 8 月任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2017 年 12 月起任渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2017 年 12 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。2018 年 2 月起担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2020 年 11 月起担任渤海汇金汇裕 87 个月定开基金基金经理。2021 年 8 月起任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
高延龙	本基金的基金经理	2020 年 11 月 13 日	-	1 年	墨尔本大学金融学硕士，特许金融分析师 (CFA)，2013 年 3 月至 2015 年 3 月就职于联合资信评估有限公司，任分析师。2015 年 3 月至 2016 年 1 月就职于国开城市交通投资发展基金，任投资经理。2016 年 2 月至 2020 年 3 月就职于渤海人寿保险股份有限公司，任债券投资经理。2020 年 3 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，2020 年 6 月起任渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 8 月起任汇添金货币市场基金基金经理。2020 年 11 月起担任渤海汇金汇裕 87 个月定开基金基金经理。2021 年 8 月起任渤海汇金兴荣一年定期开放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

#### 4.1.4 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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券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。

##### 4.3.2.1 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，随着国内经济基本面趋弱及货币政策稳中有松，债市走出了超预期的牛市，10 年期国债和国开债收益率全年分别下行 37bp 和 45bp，至 2.78% 和 3.08%。上半年，10 年期国债在 3.3% 位置获得支撑后开始对利空因素有所钝化，3 月下旬在资金足够充裕情况下，收益率逐渐回落，并往年年初水平靠拢，但 6 月份低超储率及地方债放量发行等因素导致资金面波动性明显加大，同时伴随美联储议息决议超预期转鹰，债市出现了一波显著调整。不过，自 2020 年底金融数据率先见顶后，经济在二季度便逐渐开始呈现见顶态势。进入下半年，央行于 7 月初超预期降准，带动收益率快速回落，随后水灾及疫情反复冲击经济，同时本季度地产和城投均受到持续的高压调控，且受能源双控政策的影响，限电停产进一步压制经济回暖，全季看 10 年期国债和国开债收益率下行幅度分别达到 20bp 和 29bp。随后在 10 月中旬，市场对再度降准的预期受到纠偏，监管对房地产过度调控政策也进行了修正说明，收益率开始大幅调整，而在逼近 7 月初降准前点位后开始逐步回落，最终在上游价格管控、疫情反复、经济承压、流动性充裕、年内二度降准及宽松预期升级等一系列因素推升下，年末收益率创出了年内新低。

### 4.4.2 总体来看，报告期内，本基金于一季度把握合理时机进行了加仓，组合杠杆水平有所提升，后续杠杆保持稳定。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 1.0040 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.99%，业绩比较基准收益率为 3.73%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2022 年，一方面由于地产拖累经济情况仍未见好转，叠加奥密克戎病毒区域性扩散，导致经济下行压力不减；另一方面，2022 年全年稳字当头定调，货币政策要配合宽信用落地，流动性须有保障，同时，面对美联储 3 月份加息的高度预期，留给国内方面的宽松窗口有所收窄，再考虑到地方债发行加快、财政支出前置以及信贷早投放早见效等因素，1 月中旬央行便如期调降 OMO/MLF 利率均 10bp，而 1 月份金融机构积极响应稳增长政策，社融和信贷数据也是双双创出历史新高水平。往后看，随着地产政策进一步放松及基建发力，宽信用效果将有所显现，叠加外部加息冲击，债市回调压力增加。下半年，债市核心可能将转向经济企稳向好强度的预期差，以及海外加息节奏变化，债市波动性有望继续增大，票息和短线交易价差可能将成为收益主要来源。

## 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，对基金的投资、交易、运营等环节，实施事前、事中和事后的风险管理，努力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。

本报告期内，主要监察稽核工作如下：

(1) 本基金管理人加快建设“合规、诚信、专业、稳健”的企业文化，完善制度建设及工作机制。加强对重大决策、新产品、新业务及重要业务活动等的合规审查工作，有效防范和化解了相关的合规风险。

按照监管要求，完成反洗钱工作报告及报表、非居民金融账户涉税尽职调查等工作。组织开展客户适当性管理、廉洁从业、债券投资交易等多项检查。组织开展反洗钱专项等合规培训，增加合规培训覆盖面和培训力度，提升公司整体合规意识。

(2) 本基金管理人的风险控制工作结合市场情况和监管要求，根据业务类型特点及风险管理的需要，不断完善风险管理组织架构。制定公司总体风险偏好、风险限额，并根据业务需求对各类风险限额进行分解及动态管理，全年未出现超出限额的重大风险损失。

本基金管理人持续健全风险管理制度，完善风险管理信息系统，修订《全面风险管理规定》等制度，推动公募基金压力测试模块、交易所交易行为控制模块测试上线工作，加强对公募基金压力测试及异常交易行为的系统化管理。增强产品投资信用风险的监测预警，揭示相关的信用风险，助力投资部门化解潜在信用风险。加强新产品风险评估，从系统、制度、人员、运作模式、主要风险、应急等方面进行了专项的事前风险评估。组织开展各类压力测试，优化流动性压力测试开放期概率计算方法，完善流动性缺口假设。

(3) 稽核部门对公司业务、内部控制、风险管理等实施独立、客观的监督、评价和建议，完成反洗钱专项稽核等工作。选聘会计师事务所开展原董事长的离任审计。

本报告期，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，努力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（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，本报告期内，本基金进行了 1 次分红。以 2021 年 11 月 24 日已实现的可分配收益 323,953,518.01 元为基准计算，2021 年 11 月 30 日向渤海汇金汇增利 3 个月定开基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.404 元。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### **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 人或者基金资产净值低于 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 323,210,648.01 元。

### 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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(22)第 P02265 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	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“渤海汇金汇裕 87 个月定开基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>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和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,公允反映了渤海汇金汇裕 87 个月定开基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
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职业道德守则,我们独立于渤海汇金汇裕 87 个月定开基金,并履行了职业道德方面的其他责任。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	<p>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。其他信息包括渤海汇金汇裕 87 个月定开基金 2021 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> <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和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渤海汇金汇裕 87 个月定开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渤海汇金汇裕 87 个月定开基金、终止经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渤海汇金汇裕 87 个月定开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</p>

	<p>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，就可能导致对渤海汇金汇裕 87 个月定开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渤海汇金汇裕 87 个月定开基金不能持续经营。</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	曹丽娜	张冠楠
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日	

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：渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,776,878.09	3,084,659.64
结算备付金		54,000,024.69	69,047,628.56
存出保证金		-	0.08
交易性金融资产	7.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	473,969,779.12	335,130,718.58
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	13,829,726,578.56	9,279,339,453.65
资产总计		14,360,473,260.46	9,686,602,460.51
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		6,323,670,459.00	1,648,277,167.57
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,021,661.45	1,019,461.30
应付托管费		340,553.84	339,820.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	156,083.21	42,843.06
应交税费		-	-
应付利息		2,709,802.64	708,290.71

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	209,000.00	3,000.00
负债合计		6,328,107,560.14	1,650,390,583.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	8,000,263,574.27	8,000,263,574.27
未分配利润	7.4.7.10	32,102,126.05	35,948,303.16
所有者权益合计		8,032,365,700.32	8,036,211,877.43
负债和所有者权益总计		14,360,473,260.46	9,686,602,460.51

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0040 元，基金份额总额 8,000,263,574.27 份。

2、资产负债表中其他资产为分类为持有至到期投资的债券投资。

## 7.2 利润表

会计主体：渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 10 日(基 金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		469,719,946.77	39,801,441.50
1. 利息收入		469,719,946.77	39,801,441.50
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,047,361.34	1,930,638.79
债券利息收入		468,672,585.43	32,075,006.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	5,795,796.61
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-

<b>减：二、费用</b>		150,355,475.87	3,853,138.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,246,814.13	1,675,695.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,082,271.40	558,565.16
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,574.99	-
5. 利息支出		133,780,679.89	1,614,272.71
其中：卖出回购金融资产支出		133,780,679.89	1,614,272.71
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	243,135.46	4,605.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		319,364,470.90	35,948,303.16
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		319,364,470.90	35,948,303.16

注：本财务报表上年度可比期间的实际编制期间为 2020 年 11 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	8,000,263,574.27	35,948,303.16	8,036,211,877.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	319,364,470.90	319,364,470.90
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）	-	-323,210,648.01	-323,210,648.01
五、期末所有者权益（基金净值）	8,000,263,574.27	32,102,126.05	8,032,365,700.32



项目	上年度可比期间 2020 年 11 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 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)	8,000,263,574.27	-	8,000,263,574.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	35,948,303.16	35,948,303.16
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)	8,000,263,574.27	35,948,303.16	8,036,211,877.43

注：本财务报表上年度可比期间的实际编制期间为 2020 年 11 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日。

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：

<u>麻众志</u>	<u>边燕萍</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金 (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会证监许可 (2020) 1250 号《关于准予渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券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《渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券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 7,999,996,902.96 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 (2020) 第 0938 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金合

同》于 2020 年 11 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 8,000,263,574.27 份基金份额，其中认购资金利息折合 266,671.31 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券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良好流动性的金融工具，包括债券(国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款等)等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)。本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前 3 个月、开放期及开放期结束后 3 个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期内本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，在封闭期内本基金不受上述 5% 的限制；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为封闭期起始日中国人民银行公布的银行三年期定期存款利率(税后)+1%。

本财务报表由本基金的基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司于 2022 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本期会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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。本基金本报告期内及上年度可比期间内持有持有至到期投资和应收款项，暂无以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及可供出售金融资产。

本基金目前持有至到期投资包括债券投资等，在财务报表中以“其他资产”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、结算备付金和应收利息等。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。本基金本报告期内及上年度可比期间内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卖出回购金融资产款、应付管理人报酬和其他各类应付款项等。

#### 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

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。应收款项、持有至到期投资和其他金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；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。持有至到期投资，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。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。表明金融资产发生减值的客观证据，是指金融资产初始确认后实际发生的、对该金融资产的预计未来现金流量有影响，且本基金能够对该影响进行可靠计量的事项。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，将其账面价值减记至按照该金融资产的原实际利率折现确定的预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值，减记金额确认为减值损失，计入当期损益。金融资产确认减值损失后，如有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，但金融资产转回减值损失后的账面价值不超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金的债券投资等金融资产，均以实际利率法计算的摊余成本进行估值并评估减值准备。本基金按照企业会计准则的要求，评估金融资产是否发生减值，如有客观证据表明其发生减值的，计提减值准备。

实际利率法是指按照金融资产或金融负债(含一组金融资产或金融负债)的实际利率计算其摊余成本及各期利息收入或支出的方法。实际利率是指将金融资产或金融负债在预期存续期间或适用的更短期间内的未来现金流量，折现为该金融资产或金融负债当前账面价值所使用的利率。在计算实际利率时，本基金在考虑金融资产或金融负债所有合同条款的基础上预计未来现金流量(不考虑未来的信用损失)，同时还考虑金融资产或金融负债合同各方之间支付或收取的、属于实际利率组成部分的各项收费、交易费用及折价或溢价等。

如有确凿证据表明本基金在封闭期内买入持有至到期的投资策略发生变化或其他原因，导致按原有摊余成本法计量不能客观反映上述资产或负债于开放期内的公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映上述资产或负债于开放期内的公允价值的方法估值。如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

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。

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。

#### **7.4.4.10 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。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金的每一基金份额享有同等分配权。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。

#### **7.4.4.12 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。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

持有至到期投资是否减值在很大程度上依赖于基金管理人的判断。本基金的基金管理人定期审阅持有至到期投资以评估其是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。发生减值的客观证据包括评估日该金融工具可观察的市场价值出现严重下跌，发行方发生严重财务困难使该金融资产无法在活跃市场继续交易、无法履行合同条款(例如，无法按期偿付利息或本金)等。在进行判断的过程中，本基金的基金管理人需评估发生减值的客观证据对该项投资预计未来现金流的影响。

### **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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **7.4.5.3 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。

### **7.4.6 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) 对本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) 对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	2,776,878.09	3,084,659.64
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	-	-
合计：	2,776,878.09	3,084,659.64

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有交易性金融资产。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 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未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	284.77	378.41
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	26,730.00	34,178.54
应收债券利息	473,942,764.35	335,096,161.63
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	473,969,779.12	335,130,718.58

注：其他包括应收存出保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
持有至到期投资	13,829,726,578.56	9,279,339,453.65
合计	13,829,726,578.56	9,279,339,453.65

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的持有至到期投资为债券投资，其中交易所市场债券人民币 4,067,183,964.66 元，银行间市场债券人民币 9,762,542,613.90 元。上述持有至到期投资均无需计提减值准备。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	156,083.21	42,843.06
合计	156,083.21	42,843.06

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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	-	-
预提费用	209,000.00	3,000.00
合计	209,000.00	3,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,000,263,574.27	8,000,263,574.27
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 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	8,000,263,574.27	8,000,263,574.27

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金以定期开放式运作，开放期内开放申购或赎回，封闭期内不开放申购或赎回。

#### 7.4.7.10 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
上年度末	35,948,303.16	-	35,948,303.16
本期利润	319,364,470.90	-	319,364,470.90
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	-323,210,648.01	-	-323,210,648.01
本期末	32,102,126.05	-	32,102,126.05

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年11月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	56,999.75	1,448,535.64
定期存款利息收入	-	388,888.89
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	989,278.90	93,214.26
其他	1,082.69	-
合计	1,047,361.34	1,930,638.79

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无股票投资收益。

##### 7.4.7.12.2 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。

**7.4.7.12.3 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。

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益。

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年11月10日(基金 合同生效日)至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	-	1,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	-	1,000.00
减：应收利息总额	-	-
买卖债券差价收入	-	-

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-买卖债券差价收入。

**7.4.7.13.3 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。

**7.4.7.13.4 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。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

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。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 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。

**7.4.7.14.2 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。

**7.4.7.14.3 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。

**7.4.7.14.4 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。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 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。

**7.4.7.15.2 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。

**7.4.7.16 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。

**7.4.7.17 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损益。

**7.4.7.18 其他收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他收入。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年11月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	2,574.99	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	2,574.99	-

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年11月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日
审计费用	80,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-

证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	6,135.46	1,205.00
其他费用	700.00	400.00
银行间账户维护费	36,300.00	3,000.00
合计	243,135.46	4,605.00

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
渤海证券股份有限公司（“渤海证券”）	基金管理人的独资股东

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。

#### 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 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。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,246,814.13	1,675,695.47
其中：支付销售机构的客户维护费	8.32	-

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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 11 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,082,271.40	558,565.16

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无销售服务费。

### 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未发生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发生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。

##### 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发生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。

#### 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年11月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日
基金合同生效日(2020年11月10日)持有的基金份额	-	7,357.63
报告期初持有的基金份额	7,357.63	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额	7,357.63	7,357.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

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。

##### 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可比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。

#### 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年11月10日(基金合同生效日)至2020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



兴业银行	2,776,878.09	56,999.75	3,084,659.64	1,448,535.64
------	--------------	-----------	--------------	--------------

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管，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未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 11 月 29 日	-	2021 年 11 月 29 日	0.4043	23,210,648.01	-	323,210,648.01	
合计	-	-		0.4043	23,210,648.01	-	323,210,648.01	

#### 7.4.12 期末（2021 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：本基金本报告期末未持有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

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 3,021,770,459.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代 码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
180205	18 国开 05	2022 年 1 月 6 日	107.33	21,907,000	2,351,205,949.55

180205	18 国开 05	2022 年 1 月 4 日	107.33	9,422,000	1,011,232,138.43
合计				31,329,000	3,362,438,087.98

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 3,301,900,000.00 元，于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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参与转融通证券出借业务的证券余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为 87 个月定期开放发起式债券型基金，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。日常经营活动中本基金面临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。

### 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，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

注：无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	1,548,255,467.74	-
AAA 以下	-	-
未评级	12,281,471,110.82	9,279,339,453.65
合计	13,829,726,578.56	9,279,339,453.65

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券等无债项评

级的债券。

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

### **7.4.13.3 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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款人民币 6,323,670,459.00 元将在 1 个月以内到期且计息外，本基金所持有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，因此未折现的合约到期现金流量为人民币 6,334,070,155.72 元(于 2020 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款人民币 1,648,277,167.57 元将在 1 个月以内到期且计息外，本基金所持有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，因此未折现的合约到期现金流量为人民币 1,651,399,569.54 元)。

#### **7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

#### **7.4.13.3.2 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，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 7.4.12。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 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有流动性受限资产(2020 年 12 月 31 日：无)。

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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	2,776,878.09	-	-	-	-	2,776,878.09
结算备付金	54,000,024.69	-	-	-	-	54,000,024.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-473,969,779.12	473,969,779.12
其他资产	-	-	-	-13,829,726,578.56	-	-13,829,726,578.56
资产总计	56,776,902.78	-	-	-13,829,726,578.56	-473,969,779.12	14,360,473,260.46
负债						

卖出回购金融资产款	6,323,670,459.00	-	-	-	-	6,323,670,459.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,021,661.45	1,021,661.45
应付托管费	-	-	-	-	340,553.84	340,553.84
应付交易费用	-	-	-	-	156,083.21	156,083.21
应付利息	-	-	-	-	2,709,802.64	2,709,802.64
其他负债	-	-	-	-	209,000.00	209,000.00
负债总计	6,323,670,459.00	-	-	-	4,437,101.14	6,328,107,560.14
利率敏感度缺口	-6,266,893,556.22	-	-	-13,829,726,578.56	469,532,677.98	8,032,365,700.32
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						
银行存款	3,084,659.64	-	-	-	-	3,084,659.64
结算备付金	69,047,628.56	-	-	-	-	69,047,628.56
存出保证金	0.08	-	-	-	-	0.08
交易性金	-	-	-	-	-	-

融 资 产							
应 收 利 息		-	-	-	-335,130,718.58	335,130,718.58	
其 他 资 产		-	-	-	9,279,339,453.65	9,279,339,453.65	
资 产 总 计	72,132,288.28	-	-	-	9,279,339,453.65	335,130,718.58	9,686,602,460.51
负 债							
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	1,648,277,167.57	-	-	-	-	-	1,648,277,167.57
应 付 管 理 人 报 酬		-	-	-	-	1,019,461.30	1,019,461.30
应 付 托 管 费		-	-	-	-	339,820.44	339,820.44
应 付 交 易 费 用		-	-	-	-	42,843.06	42,843.06
应 付 利 息		-	-	-	-	708,290.71	708,290.71
其 他 负 债		-	-	-	-	3,000.00	3,000.00
负 债 总 计	1,648,277,167.57	-	-	-	-	2,113,415.51	1,650,390,583.08
利 率 敏 感 度 缺 口	-1,576,144,879.29	-	-	-	9,279,339,453.65	333,017,303.07	8,036,211,877.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金对债券组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，因此市场利率变动对本基金的基金资产净值无重大影响。本基金的基金管理人主要通过合理配置债券组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。



#### 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以及银行间同业市场交易的固定收益品种，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

注：无。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：无。

#### 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。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	-	-

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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日及 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日及 2020 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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、持有至到期投资和其他金融负债等，除持有至到期投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。其账面价值与公允价值相差很小。

截止 2021 年 12 月 31 日，本基金持有至到期投资的账面价值：13,829,726,578.56 元，公允价值：14,216,085,000.00 元（截止 2020 年 12 月 31 日，本基金持有至到期投资的账面价值：9,279,339,453.65 元，公允价值：9,328,446,000.00 元）。

持有至到期投资按如下原则确定公允价值：(i) 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。(ii) 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。(iii) 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。

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》的有关规定，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、可交换债券除外），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。于2021年12月31日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次（于2020年12月31日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次）。

(2)除公允价值外，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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,829,726,578.56	96.30
	其中：债券	13,829,726,578.56	96.30
	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	56,776,902.78	0.40
8	其他各项资产	473,969,779.12	3.30
9	合计	14,360,473,260.46	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 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。

### 8.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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

注：本基金本报告期内未持有股票。

#### 8.4.2 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

注：本基金本报告期内未持有股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未持有股票。

## 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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,142,038,763.57	138.71
	其中：政策性金融债	11,142,038,763.57	138.71
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	2,687,687,814.99	33.46
10	合计	13,829,726,578.56	172.18

## 8.6 期末按摊余成本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）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	180205	18 国开 05	68,000,000	7,519,440,000.00	93.61
2	018019	国开 2102	13,800,000	1,414,776,000.00	17.61
3	200209	20 国开 09	7,800,000	798,564,000.00	9.94
4	173082	21 江苏 01	6,900,000	702,903,000.00	8.75
5	173108	21 安徽 01	6,800,000	693,804,000.00	8.64

## 8.7 期末按摊余成本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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

无

### 8.10.2 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。

**8.10.3 本期国债期货投资评价**

无

**8.11 投资组合报告附注**

**8.11.1 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

**8.11.2 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

**8.11.3 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	473,969,779.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	473,969,779.12

**8.11.4 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。

**8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末未持有股票。

**8.11.6 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。

## § 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

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
208	38,462,805.65	8,000,242,023.33	100.00%	21,550.94	0.00%

### 9.2 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	3,776.63	0.00%

### 9.3 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

### 9.4 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：不涉及，期末无兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 11 月 10 日）基金份额总额	8,000,263,574.27
本报告期期初基金份额总额	8,000,263,574.27
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	-
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	8,000,263,574.27

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 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。

3、本基金管理人于 2021 年 8 月 5 日发布公告，自 2021 年 8 月 4 日起，徐海军先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的合规总监，原合规总监刘嫣女士离任。

4、本基金管理人于 2021 年 11 月 23 日发布公告，自 2021 年 11 月 21 日起，边燕萍女士担任渤海汇金证券资产管理有限公司的财务负责人，原财务负责人赵猛先生离任。

5、本基金管理人于 2021 年 11 月 28 日发布公告，自 2021 年 11 月 26 日起，渤海汇金证券资产管理有限公司代理党总支书记齐朝晖先生离任。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金管理人于 2021 年 10 月 27 日发布了《渤海汇金证券资产管理有限公司改聘会计师事务所公告》的公告，自 2021 年 10 月 25 日起，本基金的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。本报告期应支付审计费用 80,000.00 元。截至本报告期末，该审计机构已为本基金提供审计服务 3 个月。

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

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。

**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	
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计。

## 2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准：券商经营行为规范；具有较强的研究服务能力，包括研究及投资建议质量、报告的及时性和服务质量；交易佣金收费合理。

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

3、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。

**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	
	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

兴业证券	1,729,575,500.00	100.00%	161,088,900,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	关于旗下部分基金增加和耕传承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	证券时报、公司网站	2021 年 1 月 19 日
2	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告的提示性公告	证券时报	2021 年 1 月 22 日
3	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站	2021 年 1 月 22 日
4	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	证券时报、公司网站	2021 年 2 月 24 日
5	渤海汇金证券资产管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	证券时报、公司网站	2021 年 3 月 5 日
6	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	证券时报、公司网站	2021 年 3 月 17 日
7	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	证券时报、公司网站	2021 年 3 月 20 日
8	2021 年度渤海汇金证券资产管理	证券时报、公司网站	2021 年 4 月 22 日

	有限公司高级管理人员变更公告		
9	渤海汇金证券资产管理有限公司 旗下全部基金 2021 年第 1 季度报 告的提示性公告	证券时报	2021 年 4 月 22 日
10	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放 债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站	2021 年 4 月 22 日
11	渤海汇金证券资产管理有限公司 旗下 6 只基金招募说明书(更新) 及基金产品资料概要(更新)提 示性公告	证券时报	2021 年 5 月 13 日
12	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放 债券型证券投资基金基金产品资 料概要(更新)	公司网站	2021 年 5 月 13 日
13	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放 债券型证券投资基金招募说明书 (更新)(2021 年第 1 号)	公司网站	2021 年 5 月 13 日
14	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	证券时报、公司网站	2021 年 6 月 28 日
15	关于旗下部分基金增加北京广源 达信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	证券时报、公司网站	2021 年 7 月 2 日
16	渤海汇金证券资产管理有限公司 旗下全部基金 2021 年第 2 季度报 告提示性公告	证券时报	2021 年 7 月 21 日
17	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放 债券型证券投资基金 2021 年第 2	公司网站	2021 年 7 月 21 日

	季度报告		
18	关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	证券时报、公司网站	2021 年 7 月 23 日
19	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券时报	2021 年 7 月 27 日
20	渤海汇金证券资产管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告	证券时报、公司网站	2021 年 7 月 27 日
21	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同（2021 年 7 月修订）	公司网站	2021 年 7 月 27 日
22	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议（2021 年 7 月修订）	公司网站	2021 年 7 月 27 日
23	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2021 年第 2 号）	公司网站	2021 年 7 月 27 日
24	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（合规总监）变更公告	证券时报、公司网站	2021 年 8 月 5 日
25	关于旗下部分基金增加上海爱建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	证券时报、公司网站	2021 年 8 月 25 日
26	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年中期报告	公司网站	2021 年 8 月 31 日
27	渤海汇金证券资产管理有限公司	证券时报	2021 年 8 月 31 日

	旗下全部基金 2021 年中期报告的提示性公告		
28	渤海汇金证券资产管理有限公司改聘会计师事务所公告	证券时报、公司网站	2021 年 10 月 27 日
29	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 3 季度报告的提示性公告	证券时报	2021 年 10 月 27 日
30	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	公司网站	2021 年 10 月 27 日
31	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（财务负责人）变更公告	证券时报、公司网站	2021 年 11 月 23 日
32	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	证券时报、公司网站	2021 年 11 月 28 日
33	渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金分红公告	证券时报、公司网站	2021 年 11 月 29 日

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20211231	3,900,098,999.00	0.00	0.00	3,900,098,999.00	48.75%
	2	20210101-20211231	3,600,119,000.00	0.00	0.00	3,600,119,000.00	45.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。</li> <li>2. 单一大额投资者大额赎回时为应对赎回证券变现产生的冲击成本的风险。</li> <li>3. 单一大额投资者退出后，可能出现迷你基金的情形，可能影响投资目标的实现。</li> <li>4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。</li> </ol>							

### 12.2 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。

## § 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裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券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、渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金在指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：400-651-5988/400-651-1717

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 3 月 31 日