

# 渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行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	8
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	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
<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>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	46
7.2 报告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 .....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	57
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	60

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金
基金简称	渤海汇金量化成长混合
场内简称	-
基金主代码	005536
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 28 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	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	53,250,848.57 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	本基金通过构建数量化投资策略，重点选择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) 股票投资策略</p> <p>(1) 基本面量化策略：深入研究优质成长股具有的财务基本面特征，并将其进行数量化表达，形成基于基本面的量化投资体系。基本面特征包括但不限于估值、营收、盈利、杠杆、周转率等。通过该体系，筛选基本面优秀，或者基本面正在好转的成长股构建投资组合。</p> <p>(2) 多因子选股策略：通过对股票历史数据的数量化分析，建立影响股票价格的因子库。通过对各类因子打分构建多因子模型，筛选出收益预期较高的股票组合。本基金使用的因子不仅包括公司盈利能力、成长性、一致预期、估值等基本面类因子，同时也包括股票价格波动相关的各类技术指标，例如价格波动率、成交量、动量趋势、超买超卖等。本基金通过对量化模型中各类因子的持续跟踪来监控因子的有效性，根据市场状况结合因子变化趋势，动态选取最优因子构</p>

建股票多头组合。

(3) 事件套利选股策略：通过跟踪分析对投资者行为产生一定影响，可造成市场短期价格波动的事件来获取超额投资收益。此类事件包括但不限于定向增发、股东增持、股权激励、业绩公告、资产注入等，相关事件信息要素均由上市公司公告等公开渠道获得。

### (三) 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。

### (四) 股指期货投资策略

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。

### (五) 国债期货投资策略

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	中证 500 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	麻众志	陆志俊
	联系电话	010-68784289	95559
	电子邮箱	mazz@bhjq.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-651-5988/ 400-651-1717	95559
传真		022-23861651	021-62701216
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	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 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	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		518054	200336
法定代表人		刘嫣	任德奇

### 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	-11,324,428.05
本期利润	-8,014,773.76
加权平均基金份额本期利润	-0.1374
本期加权平均净值利润率	-15.45%
本期基金份额净值增长率	-12.49%
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	-10,171,510.52
期末可供分配基金份额利润	-0.1910
期末基金资产净值	46,905,791.31
期末基金份额净值	0.8808
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	-11.92%

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

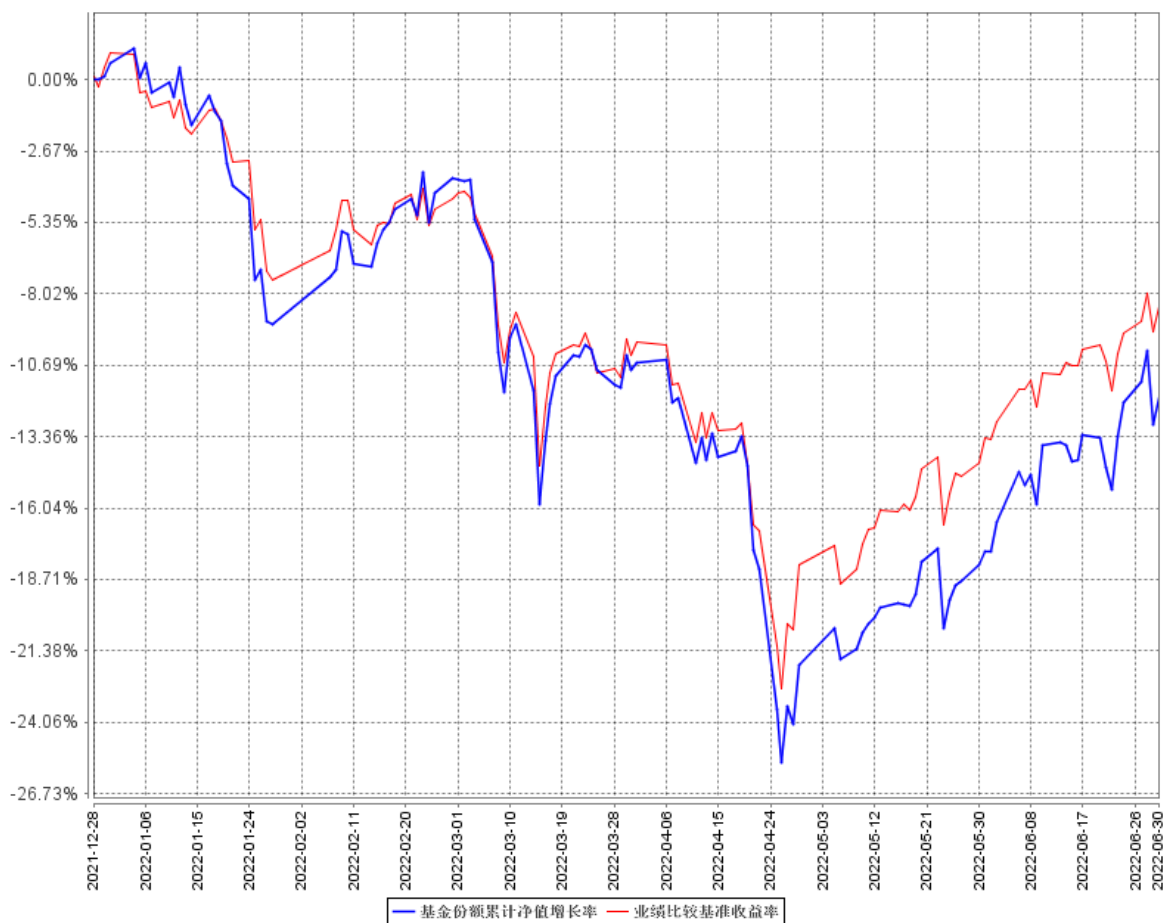
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.00%	1.40%	5.66%	0.88%	1.34%	0.52%
过去三个月	-1.17%	1.69%	1.99%	1.40%	-3.16%	0.29%
过去六个月	-12.49%	1.56%	-9.41%	1.30%	-3.08%	0.26%
自基金合同生效起至今	-11.92%	1.54%	-8.51%	1.28%	-3.41%	0.26%

注：业绩比较基准：中证500指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%

### 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 12 月 28 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年；  
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

### 3.3 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12月28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月起担任

					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《渤海汇金量化成长混合型发起式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。

本基金对标中证 500 指数，通过量化多策略选股构建中盘成长风格投资组合，并动态跟踪调整策略间配置比例，力争取得稳定超越中证 500 指数的收益。一季度，基金持续挖掘具有业绩高速增长潜力的标的并获取超越中证 500 指数的收益表现，但在反弹行情中策略阿尔法收益并未得到较好体现，而且低于我们的预期，我们仍努力对策略进行持续优化，期望策略阿尔法收益能够在市场波动中获得更好表现。

#### 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 0.8808 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.49%，业绩比较基准收益率为-9.41%。

#### 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。在基金投资思路我们将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。我们将通过多风格多策略的量化选股模型，进一步丰富阿尔法收益来源降低阿尔法收益波动，同时对策略模型进行持续优化以期具备更好的市场适应能力从而获得更优的收益表现。

#### 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**

本基金为发起式基金，截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## § 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，基金托管人在渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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，渤海汇金证券资产管理有限公司在渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由渤海汇金证券资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金

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	3,376,902.93	4,033,620.15
结算备付金		1,020,369.51	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	42,719,050.10	53,479,220.10
其中：股票投资		42,719,050.10	53,479,220.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	3,990,401.28
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		19.98	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		47,116,342.52	61,503,241.53
<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		87,583.35	-
应付管理人报酬		45,318.43	6,029.15
应付托管费		7,553.07	1,004.85
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		672.00	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	69,424.36	-
负债合计		210,551.21	7,034.00
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	53,250,848.57	61,098,365.18
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-6,345,057.26	397,842.35
净资产合计		46,905,791.31	61,496,207.53
负债和净资产总计		47,116,342.52	61,503,241.53

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8808 元，基金份额总额 53,250,848.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-7,584,093.01	-
1.利息收入		32,110.86	-
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,823.42	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,287.44	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,942,186.94	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,373,144.86	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	19,769.51	-
股利收益	6.4.7.19	411,188.41	-
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	3,309,654.29	-
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	16,328.78	-
<b>减：二、营业总支出</b>		430,680.75	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	309,243.79	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	51,540.60	-
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		72.00	-
8. 其他费用	6.4.7.23	69,824.36	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-8,014,773.76	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-8,014,773.76	-
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-8,014,773.76	-

注：本基金合同于 2021 年 12 月 28 日生效，无上年度可比期间数据（下同）。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金

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）	-	-	-	-
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）	61,098,365.18	-	397,842.35	61,496,207.53

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,847,516.61	-	-6,742,899.61	-14,590,416.22
(一)、综合收益总额	-	-	-8,014,773.76	-8,014,773.76
(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)	-7,847,516.61	-	1,271,874.15	-6,575,642.46
其中: 1.基金申购款	98,325.30	-	-16,072.97	82,252.33
2.基金赎回款	-7,945,841.91	-	1,287,947.12	-6,657,894.79
(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)	53,250,848.57	-	-6,345,057.26	46,905,791.31
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 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)	-	-	-	-
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(一)、综合收益总额	-	-	-	-
(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)	-	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	-	-	-	-

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：

麻众志                                      边燕萍                                      刘云鹏  
 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

渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金(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]3170号《关于准予渤海汇金军工安全主题灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》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《渤海汇金量化成长混合型发起式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61,075,929.00元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(21)第00699号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》于2021年12月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为61,098,365.18份基金份额,其中认购资金利息折合22,436.18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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金量化成长混合型发起式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、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、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、公开发行的次级债、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。

本基金业绩比较基准：中证 500 指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%。

#### 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》、《渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》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相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 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。

##### 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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资

产的合同现金流量特征。本基金现无以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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卖出回购金融资产款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，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，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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权

定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 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

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。

#### 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，本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央国债登记结算有限责任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

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

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 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《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进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	3,376,902.93
等于：本金	3,376,578.87
加：应计利息	324.06
减：坏账准备	-
合计：	3,376,902.93

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	38,969,903.95	-	42,719,050.10	3,749,146.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	38,969,903.95	-	42,719,050.10	3,749,146.15

#### 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	69,424.36
合计	69,424.36

## 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	61,098,365.18	61,098,365.18
本期申购	98,325.30	98,325.30
本期赎回（以“-”号填列）	-7,945,841.91	-7,945,841.91
- 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	53,250,848.57	53,250,848.57

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	-41,649.51	439,491.86	397,842.35
本期利润	-11,324,428.05	3,309,654.29	-8,014,773.76
本期基金份额交易	1,194,567.04	77,307.11	1,271,874.15

产生的变动数			
其中：基金申购款	-20,366.35	4,293.38	-16,072.97
基金赎回款	1,214,933.39	73,013.73	1,287,947.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,171,510.52	3,826,453.26	-6,345,057.26

#### 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	7,823.42
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	7,823.42

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——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	254,627,111.62
减：卖出股票成本总额	265,340,901.97
减：交易费用	659,354.51
买卖股票差价收入	-11,373,144.86

#### 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

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 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：无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 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-买卖资产支持证券差价收入。

##### 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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022年1月1日至2022年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	20,000.00

## 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	411,188.41
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	411,188.41

## 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	3,309,654.29
——股票投资	3,309,654.29
——债券投资	-
——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	3,309,654.29

**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	16,328.78
合计	16,328.78

**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	59,507.37
证券出借违约金	-
其他费用	400.00
合计	69,824.36

**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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

汇金资管”)	
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
渤海证券股份有限公司(“渤海证券”)	基金管理人的独资股东、基金销售机构、基金证券经纪商

#### 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1月1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	505,893,197.30	100.00%	-	-

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 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1月1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	133,500,000.00	100.00%	-	-

###### 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	361,021.62	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1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
-	-	-	-	-

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1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	309,243.79	-
其中：支付销售机构的客户维护费	124,603.12	-

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1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	51,540.60	-

注：支付基金托管人交通银行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1月1日至2021年6月30日
基金合同生效日（2021年12月28日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,527.83	-
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	10,000,527.83	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.78%	-

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1月1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

交通银行	-	-	-
渤海证券	3,376,902.93	7,823.42	

注：1、本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，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

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。

##### 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交易所市场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

注：无。

#### 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。

本基金本期未投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此未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	4,397,272.44	-	-	-	-	4,397,272.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-42,719,050.10	-42,719,050.10
应收申购款	-	-	-	-	19.98	19.98
资产总计	4,397,272.44	-	-	-	-42,719,070.08	47,116,342.52
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	87,583.35	87,583.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	45,318.43	45,318.43
应付托管费	-	-	-	-	7,553.07	7,553.07
应交税费	-	-	-	-	672.00	672.00
其他负债	-	-	-	-	69,424.36	69,424.36
负债总计	-	-	-	-	210,551.21	210,551.21
利率敏感度缺口	4,397,272.44	-	-	-	-42,508,518.87	46,905,791.31
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	4,031,789.46	-	-	-	-	4,031,789.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-53,479,220.10	53,479,220.10
买入返售金融资产	4,000,000.00	-	-	-	-	4,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-7,768.03	-7,768.03
资产总计	8,031,789.46	-	-	-	-53,471,452.07	61,503,241.53
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	6,029.15	6,029.15
应付托管费	-	-	-	-	1,004.85	1,004.85
负债总计	-	-	-	-	7,034.00	7,034.00
利率敏感度缺口	8,031,789.46	-	-	-	-53,464,418.07	61,496,207.53

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：无。

#### 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	42,719,050.10	91.07	53,479,220.10	86.96
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	42,719,050.10	91.07	53,479,220.10	86.96

#### 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%	1,738,005.58	-
	业绩比较基准下降 5%	-1,738,005.58	-

#### 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	上年度末
---------------	-----	------

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
第一层次	42,719,050.10	53,479,220.10
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	42,719,050.10	53,479,220.10

#### 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	42,719,050.10	90.67
	其中：股票	42,719,050.10	90.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,397,272.44	9.33
8	其他各项资产	19.98	0.00
9	合计	47,116,342.52	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	76,480.00	0.16
B	采矿业	1,904,594.00	4.06
C	制造业	29,667,642.48	63.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,105,994.52	2.36
E	建筑业	1,373,505.00	2.93
F	批发和零售业	295,449.20	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	2,032,090.00	4.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,432,064.40	3.05
J	金融业	1,178,158.00	2.51
K	房地产业	201,591.00	0.43
L	租赁和商务服务业	200,605.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	1,108,208.50	2.36
N	水利、环境和公共设施管理业	509,866.00	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,033,333.00	2.20
R	文化、体育和娱乐业	199,414.00	0.43
S	综合	400,055.00	0.85
	合计	42,719,050.10	91.07

### 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	300037	新宙邦	25,500	1,340,280.00	2.86
2	688668	鼎通科技	18,600	1,308,324.00	2.79
3	688033	天宜上佳	55,600	1,180,944.00	2.52
4	002801	微光股份	38,100	1,137,285.00	2.42
5	600096	云天化	30,500	960,140.00	2.05
6	002895	川恒股份	28,000	946,680.00	2.02
7	601677	明泰铝业	39,000	928,200.00	1.98
8	600276	恒瑞医药	25,000	927,250.00	1.98
9	600763	通策医疗	5,200	907,088.00	1.93
10	300829	金丹科技	27,500	891,550.00	1.90
11	600018	上港集团	146,200	852,346.00	1.82
12	300327	中颖电子	17,040	848,762.40	1.81
13	002182	云海金属	33,800	847,704.00	1.81
14	600867	通化东宝	78,200	808,588.00	1.72
15	000559	万向钱潮	135,200	803,088.00	1.71
16	300938	信测标准	28,050	776,704.50	1.66
17	002996	顺博合金	50,000	760,000.00	1.62
18	600888	新疆众和	77,100	709,320.00	1.51
19	300160	秀强股份	84,400	686,172.00	1.46
20	000629	攀钢钒钛	170,100	646,380.00	1.38
21	002908	德生科技	55,160	636,546.40	1.36
22	605198	德利股份	34,500	629,280.00	1.34
23	603128	华贸物流	61,000	611,830.00	1.30
24	605169	洪通燃气	51,692	582,051.92	1.24
25	300390	天华超净	6,300	550,620.00	1.17

26	002594	比亚迪	1,600	533,584.00	1.14
27	601899	紫金矿业	55,200	515,016.00	1.10
28	000733	振华科技	3,700	503,089.00	1.07
29	002007	华兰生物	20,900	476,520.00	1.02
30	600141	兴发集团	10,200	448,698.00	0.96
31	601668	中国建筑	84,100	447,412.00	0.95
32	600673	东阳光	44,500	400,055.00	0.85
33	300593	新雷能	9,040	375,250.40	0.80
34	688516	奥特维	1,400	373,730.00	0.80
35	000803	北清环能	23,600	369,104.00	0.79
36	688385	复旦微电	5,500	358,545.00	0.76
37	000498	山东路桥	36,000	347,760.00	0.74
38	601789	宁波建工	60,000	346,800.00	0.74
39	300775	三角防务	7,000	337,050.00	0.72
40	600596	新安股份	15,400	333,410.00	0.71
41	600389	江山股份	5,400	327,942.00	0.70
42	603867	新化股份	9,400	319,318.00	0.68
43	002258	利尔化学	13,500	318,870.00	0.68
44	300832	新产业	7,000	315,770.00	0.67
45	002460	赣锋锂业	1,900	282,530.00	0.60
46	002916	深南电路	3,000	281,130.00	0.60
47	601615	明阳智能	6,800	229,840.00	0.49
48	003038	鑫铂股份	4,560	229,824.00	0.49
49	300769	德方纳米	500	204,340.00	0.44
50	300347	泰格医药	1,700	194,565.00	0.41
51	600256	广汇能源	17,500	184,450.00	0.39
52	603198	迎驾贡酒	2,300	149,822.00	0.32
53	002240	盛新锂能	2,400	144,864.00	0.31
54	002497	雅化集团	4,300	140,395.00	0.30
55	002756	永兴材料	900	136,989.00	0.29
56	002407	多氟多	2,800	136,948.00	0.29
57	300012	华测检测	5,900	136,939.00	0.29
58	600233	圆通速递	6,700	136,613.00	0.29
59	000878	云南铜业	11,700	133,263.00	0.28
60	600392	盛和资源	5,600	126,560.00	0.27
61	002966	苏州银行	20,300	123,830.00	0.26
62	600563	法拉电子	600	123,096.00	0.26
63	601958	金钼股份	13,600	120,224.00	0.26
64	603613	国联股份	1,300	115,180.00	0.25



65	603077	和邦生物	25,900	110,334.00	0.24
66	000983	山西焦煤	8,200	109,798.00	0.23
67	600486	扬农化工	800	106,624.00	0.23
68	600188	兖矿能源	2,700	106,596.00	0.23
69	000519	中兵红箭	3,600	104,940.00	0.22
70	000729	燕京啤酒	10,500	101,430.00	0.22
71	300363	博腾股份	1,300	101,387.00	0.22
72	688099	晶晨股份	1,000	101,000.00	0.22
73	603605	珀莱雅	600	99,108.00	0.21
74	002268	卫士通	2,300	98,693.00	0.21
75	603456	九洲药业	1,900	98,230.00	0.21
76	600499	科达制造	4,700	97,008.00	0.21
77	002815	崇达技术	7,500	96,075.00	0.20
78	601077	渝农商行	25,600	94,720.00	0.20
79	601168	西部矿业	7,900	93,457.00	0.20
80	600438	通威股份	1,500	89,790.00	0.19
81	300450	先导智能	1,400	88,452.00	0.19
82	603026	石大胜华	600	87,210.00	0.19
83	002326	永太科技	2,600	85,618.00	0.18
84	002065	东华软件	13,400	84,688.00	0.18
85	600022	山东钢铁	48,100	83,694.00	0.18
86	000997	新大陆	6,300	83,223.00	0.18
87	600039	四川路桥	7,900	83,187.00	0.18
88	000738	航发控制	2,900	81,490.00	0.17
89	002085	万丰奥威	15,100	81,087.00	0.17
90	000888	峨眉山 A	8,800	80,696.00	0.17
91	600008	首创环保	27,800	80,620.00	0.17
92	600667	太极实业	10,900	80,442.00	0.17
93	300724	捷佳伟创	900	80,415.00	0.17
94	600208	新湖中宝	28,600	78,936.00	0.17
95	300183	东软载波	5,300	78,387.00	0.17
96	002597	金禾实业	1,800	77,994.00	0.17
97	300308	中际旭创	2,500	77,625.00	0.17
98	603444	吉比特	200	77,600.00	0.17
99	000877	天山股份	6,300	77,490.00	0.17
100	000627	天茂集团	22,600	77,066.00	0.16
101	601118	海南橡胶	16,000	76,480.00	0.16
102	300836	佰奥智能	3,080	75,152.00	0.16
103	002812	恩捷股份	300	75,135.00	0.16

104	600138	中青旅	5,800	74,762.00	0.16
105	601225	陕西煤业	3,500	74,130.00	0.16
106	000969	安泰科技	8,300	74,036.00	0.16
107	000568	泸州老窖	300	73,962.00	0.16
108	600999	招商证券	5,100	73,491.00	0.16
109	002304	洋河股份	400	73,260.00	0.16
110	000807	云铝股份	7,400	73,112.00	0.16
111	601601	中国太保	3,100	72,943.00	0.16
112	002008	大族激光	2,200	72,886.00	0.16
113	300481	濮阳惠成	3,100	72,850.00	0.16
114	600348	华阳股份	4,700	72,662.00	0.15
115	000830	鲁西化工	4,200	72,618.00	0.15
116	000823	超声电子	7,000	72,380.00	0.15
117	000999	华润三九	1,600	72,000.00	0.15
118	601319	中国人保	14,200	71,852.00	0.15
119	001872	招商港口	4,600	71,760.00	0.15
120	601699	潞安环能	4,900	71,638.00	0.15
121	000977	浪潮信息	2,700	71,496.00	0.15
122	603369	今世缘	1,400	71,400.00	0.15
123	001979	招商蛇口	5,300	71,179.00	0.15
124	600497	驰宏锌锗	13,700	71,103.00	0.15
125	002522	浙江众成	12,500	71,000.00	0.15
126	002643	万润股份	3,400	70,924.00	0.15
127	300637	扬帆新材	9,400	70,782.00	0.15
128	000882	华联股份	35,000	70,700.00	0.15
129	002478	常宝股份	15,500	70,680.00	0.15
130	300699	光威复材	1,200	70,644.00	0.15
131	600837	海通证券	7,200	70,632.00	0.15
132	002228	合兴包装	19,500	70,590.00	0.15
133	300020	银江技术	9,500	70,585.00	0.15
134	002030	达安基因	4,100	70,479.00	0.15
135	300743	天地数码	6,100	70,455.00	0.15
136	000001	平安银行	4,700	70,406.00	0.15
137	002275	桂林三金	5,400	70,362.00	0.15
138	300419	浩丰科技	12,900	70,176.00	0.15
139	002546	新联电子	18,700	70,125.00	0.15
140	600546	山煤国际	3,600	70,056.00	0.15
141	601211	国泰君安	4,600	69,920.00	0.15
142	603339	四方科技	6,100	69,784.00	0.15

143	002767	先锋电子	6,600	69,630.00	0.15
144	600373	中文传媒	6,900	68,931.00	0.15
145	600079	人福医药	4,300	68,800.00	0.15
146	000960	锡业股份	4,100	68,757.00	0.15
147	603328	依顿电子	10,800	68,580.00	0.15
148	601898	中煤能源	6,600	68,508.00	0.15
149	600592	龙溪股份	8,600	67,940.00	0.14
150	002830	名雕股份	6,400	67,904.00	0.14
151	601298	青岛港	12,400	67,828.00	0.14
152	601988	中国银行	20,800	67,808.00	0.14
153	600664	哈药股份	22,500	67,725.00	0.14
154	603012	创力集团	11,400	67,374.00	0.14
155	603699	纽威股份	8,000	67,280.00	0.14
156	601928	凤凰传媒	9,400	67,210.00	0.14
157	600886	国投电力	6,400	67,200.00	0.14
158	300015	爱尔眼科	1,500	67,155.00	0.14
159	600612	老凤祥	1,600	66,848.00	0.14
160	600547	山东黄金	3,600	66,816.00	0.14
161	601997	贵阳银行	11,500	66,815.00	0.14
162	601088	中国神华	2,000	66,600.00	0.14
163	000544	中原环保	11,500	66,470.00	0.14
164	603766	隆鑫通用	14,400	66,384.00	0.14
165	000617	中油资本	13,800	66,378.00	0.14
166	600887	伊利股份	1,700	66,215.00	0.14
167	601996	丰林集团	22,300	66,008.00	0.14
168	600507	方大特钢	9,400	65,706.00	0.14
169	600461	洪城环境	8,100	65,529.00	0.14
170	600028	中国石化	16,000	65,280.00	0.14
171	600012	皖通高速	8,700	64,989.00	0.14
172	601933	永辉超市	15,100	64,628.00	0.14
173	601872	招商轮船	11,200	64,512.00	0.14
174	600694	大商股份	3,600	64,440.00	0.14
175	601158	重庆水务	12,000	64,200.00	0.14
176	600269	赣粤高速	18,400	63,848.00	0.14
177	600585	海螺水泥	1,800	63,504.00	0.14
178	601801	皖新传媒	13,100	63,273.00	0.13
179	603689	皖天然气	8,960	63,257.60	0.13
180	601985	中国核电	9,100	62,426.00	0.13
181	601857	中国石油	11,700	62,010.00	0.13

182	603568	伟明环保	1,800	60,066.00	0.13
183	300244	迪安诊断	1,900	59,090.00	0.13
184	601577	长沙银行	7,300	57,889.00	0.12
185	002372	伟星新材	2,400	57,696.00	0.12
186	300357	我武生物	1,100	57,233.00	0.12
187	600985	淮北矿业	3,800	55,328.00	0.12
188	600415	小商品城	9,900	55,143.00	0.12
189	601016	节能风电	11,300	54,240.00	0.12
190	002958	青农商行	15,800	52,456.00	0.11
191	600325	华发股份	6,800	51,476.00	0.11
192	600580	卧龙电驱	3,500	50,470.00	0.11
193	000825	太钢不锈	9,100	49,595.00	0.11
194	603707	健友股份	1,700	47,940.00	0.10
195	002831	裕同科技	1,600	47,280.00	0.10
196	002128	电投能源	3,300	47,256.00	0.10
197	601866	中远海发	15,400	46,200.00	0.10
198	002191	劲嘉股份	4,000	42,880.00	0.09
199	300482	万孚生物	1,000	40,710.00	0.09
200	603233	大参林	1,300	40,690.00	0.09
201	688185	康希诺	200	39,816.00	0.08
202	600873	梅花生物	3,500	39,480.00	0.08
203	603658	安图生物	800	39,112.00	0.08
204	603866	桃李面包	2,300	38,065.00	0.08
205	600566	济川药业	1,400	38,024.00	0.08
206	600808	马钢股份	10,000	37,900.00	0.08
207	601568	北元集团	5,800	36,772.00	0.08
208	300232	洲明科技	5,572	36,329.44	0.08
209	601860	紫金银行	12,600	36,162.00	0.08
210	603883	老百姓	1,040	35,235.20	0.08
211	002004	华邦健康	6,100	34,038.00	0.07
212	600582	天地科技	7,100	33,938.00	0.07
213	600597	光明乳业	2,600	32,838.00	0.07
214	000937	冀中能源	4,400	32,824.00	0.07
215	601156	东航物流	1,600	31,680.00	0.07
216	002690	美亚光电	1,300	28,184.00	0.06
217	002948	青岛银行	7,700	27,874.00	0.06
218	002867	周大生	1,700	26,401.00	0.06
219	601187	厦门银行	4,200	25,032.00	0.05
220	600901	江苏租赁	4,400	22,572.00	0.05

221	600968	海油发展	8,100	20,898.00	0.04
222	002332	仙琚制药	2,100	20,622.00	0.04
223	600928	西安银行	5,600	20,552.00	0.04
224	600787	中储股份	3,600	20,484.00	0.04
225	600648	外高桥	1,500	20,400.00	0.04
226	688368	晶丰明源	100	15,986.00	0.03
227	688606	奥泰生物	100	12,162.00	0.03
228	688068	热景生物	148	11,008.24	0.02
229	603355	莱克电气	400	10,092.00	0.02
230	601665	齐鲁银行	2,000	9,760.00	0.02
231	002946	新乳业	600	7,794.00	0.02
232	688110	东芯股份	100	3,792.00	0.01
233	688360	德马科技	100	2,662.00	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	601899	紫金矿业	2,265,902.00	3.68
2	002182	云海金属	2,012,603.00	3.27
3	603599	广信股份	1,854,689.00	3.02
4	603339	四方科技	1,807,905.00	2.94
5	000630	铜陵有色	1,662,922.00	2.70
6	600867	通化东宝	1,568,440.00	2.55
7	000408	藏格矿业	1,565,149.00	2.55
8	002539	云图控股	1,527,446.00	2.48
9	600096	云天化	1,520,243.00	2.47
10	002601	龙佰集团	1,515,133.00	2.46
11	603067	振华股份	1,492,806.00	2.43
12	300037	新宙邦	1,463,803.80	2.38
13	603155	新亚强	1,450,455.00	2.36
14	600727	鲁北化工	1,440,267.00	2.34
15	603799	华友钴业	1,425,103.00	2.32
16	002455	百川股份	1,409,792.00	2.29
17	603948	建业股份	1,409,236.00	2.29

18	300918	南山智尚	1,393,314.00	2.27
19	300818	耐普矿机	1,376,401.00	2.24
20	003019	宸展光电	1,367,427.00	2.22
21	688668	鼎通科技	1,339,801.28	2.18
22	300829	金丹科技	1,335,323.00	2.17
23	603026	石大胜华	1,334,099.00	2.17
24	300458	全志科技	1,329,500.00	2.16
25	600036	招商银行	1,326,386.00	2.16
26	300782	卓胜微	1,324,561.00	2.15
27	300504	天邑股份	1,303,412.00	2.12
28	002969	嘉美包装	1,287,403.00	2.09
29	300347	泰格医药	1,262,359.00	2.05

注：本项的“累计买入金额”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。

#### 7.4.2 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	601899	紫金矿业	1,770,943.20	2.88
2	603599	广信股份	1,756,796.00	2.86
3	000630	铜陵有色	1,693,294.00	2.75
4	603339	四方科技	1,524,120.00	2.48
5	002539	云图控股	1,522,326.00	2.48
6	603067	振华股份	1,411,255.00	2.29
7	603948	建业股份	1,380,583.00	2.24
8	002182	云海金属	1,336,253.00	2.17
9	300818	耐普矿机	1,333,534.00	2.17
10	000408	藏格矿业	1,331,843.00	2.17
11	600273	嘉化能源	1,306,471.00	2.12
12	600727	鲁北化工	1,296,634.00	2.11
13	600036	招商银行	1,270,047.00	2.07
14	000063	中兴通讯	1,261,124.00	2.05
15	000552	靖远煤电	1,255,272.00	2.04
16	002601	龙佰集团	1,247,754.00	2.03
17	603155	新亚强	1,242,341.00	2.02
18	603799	华友钴业	1,225,410.00	1.99

19	300918	南山智尚	1,224,421.00	1.99
20	002455	百川股份	1,189,690.09	1.93

注：本项的“累计卖出金额”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。

#### 7.4.3 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	251,271,077.68
卖出股票收入（成交）总额	254,627,111.62

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

在法律法规允许范围内，本基金基于谨慎原则，以套期保值为目的参与股指期货投资，以降低组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。

#### 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	19.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19.98

**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
884	60,238.52	10,000,527.83	18.78%	43,250,320.74	81.22%

### 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	901,066.61	1.69%

### 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,000,527.83	18.78	10,000,527.83	18.78	自合同生效 之日起不少 于三年
基金管理人高级 管理人员	69,981.80	0.13	-	-	-
基金经理等人员	299,921.97	0.56	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,370,431.60	19.47	10,000,527.83	18.78	自合同生效 之日起不少 于三年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 12 月 28 日）基金份额总额	61,098,365.18
本报告期期初基金份额总额	61,098,365.18
本报告期基金总申购份额	98,325.30
减：本报告期基金总赎回份额	7,945,841.91
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	53,250,848.57

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。

本基金基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

### 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	505,893,197.30	100.00%	361,021.62	100.00%	-

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	-	-	133,500,000.00	100.00%	-	-

### 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、证券时报	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	证券时报	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	证券时报	2022 年 1 月 12 日
6	渤海汇金量化成长混合型发起式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	公司网站、证券时报	2022 年 3 月 23 日
7	关于旗下部分基金增加北京中植	公司网站、证券时报	2022 年 3 月 23 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		
8	渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站	2022 年 4 月 22 日
9	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	证券时报	2022 年 4 月 22 日
10	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、证券时报	2022 年 5 月 12 日
11	渤海汇金证券资产管理有限公司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的公告	公司网站、证券时报	2022 年 5 月 17 日
12	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、证券时报	2022 年 5 月 30 日
13	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、证券时报	2022 年 5 月 31 日
14	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、证券时报	2022 年 5 月 31 日
15	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、证券时报	2022 年 6 月 2 日
16	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）基金销售有限责任公司相关信息的公告	公司网站、证券时报	2022 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量化成长混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金量化成长混合型发起式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、渤海汇金量化成长混合型发起式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