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
2022年年度报告

2022年12月31日

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 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。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....9
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
§4 管理人报告.....12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....12
4.2 管理人对报告期内本基金运作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.....16
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.....16
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
§5 托管人报告.....18
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
§6 审计报告.....19
6.1 审计报告基本信息.....19
6.2 审计报告的基本内容.....19
§7 年度财务报表.....22
7.1 资产负债表.....22
7.2 利润表.....23
7.3 净资产（基金净值）变动表.....24
7.4 报表附注.....26
§8 投资组合报告.....59
8.1 期末基金资产组合情况.....59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....59
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.....59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....60

8.6 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 60
8.7 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 60
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 60
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 61
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 61
8.11 投资组合报告附注 61
§9 基金份额持有人信息 62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 62
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 62
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 62
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 62
§10 开放式基金份额变动 63
§11 重大事件揭示 64
11.1 基金份额持有人大会决议 64
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 64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 64
11.4 基金投资策略的改变 64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 64
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 65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 65
11.8 其他重大事件 66
§12 影响投资者决策的其他重要信息 71
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 71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 71
§13 备查文件目录 72
13.1 备查文件目录 72
13.2 存放地点 72
13.3 查阅方式 72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	渤海汇金汇添益 3 个月定开
场内简称	-
基金主代码	005428
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	997,354,722.78 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	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。 1、利率预期策略与久期管理 本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化,对 GDP、CPI、国际收支等引起利率变化的相关因素进行深入的研究，分析宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断包括财政政策、货币政策在内的宏观经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置，主要有期限结构策略以及息差策略两种。 （1）期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置；当收益率曲线走势难以判断时，参考基准指数的样本券久期构建组合久期，确保组合收益超过基准收益。具体来看，又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。 1）骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

	2）子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分别于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。 （2）息差策略。通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。本组合将采取低杠杆、高流动性策略，适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报，选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种，灵活控制杠杆组合仓位，降低组合波动率。 2、类属配置策略 类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场,银行间市场和交易所市场,银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置,进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。 3、信用债券投资策略 本基金将重点投资于企业债、公司债、金融债、地方政府债、短期融资券、中期票据、可转换债券、可分离债券的纯债部分、资产支持证券等信用债券，以提高组合的收益水平。 信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，因此，一方面，本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面对收益率曲线的判断以及对信用债整体信用利差研究的基础上，确定信用债总体的投资比例。考量信用利差的整体变化趋势；另一方面,本基金还将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅,即采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面,以确定企业主体债的实际信用状况。本基金的信用债投资策略主要包括行业配置策略以及个券挖掘策略两个方面。 （1）行业配置策略。债券市场所涉及行业众多，同样宏观周期背景下不同行业的景气度的发生，本基金分别采用以下的分析策略： 1）分散化投资：发行人涉及众多行业，本组合将保持在各行业配置比例上的分散化结构，避免过度集中配置在产业链高度相关的上中下游行业。 2）行业投资：本组合将依据对下一阶段各行业景气度特征的研判，确定在下一阶段在各行业的配置比例，卖出景气度降低行业的债券，提前布局景气度提升行

	业的债券。 （2）个券挖掘策略。本部分策略强调公司价值挖掘的重要性，在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定绝对收益率目标策略，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，采取高度分散策略，重点布局优势债券，争取提高组合超额收益空间。 4、可转债投资策略 本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转债的债底保护，防范信用风险，另一方面，还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。本基金将借鉴信用债的基本面研究，从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、财务稳健性、盈利能力、治理结构等方面进行考察，精选财务稳健、信用违约风险小的可转债进行投资。 5、资产支持证券投资策略 资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。
业绩比较基准	中债综合指数（总财富）收益率×80%+1 年期定期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中中低风险/收益特征的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		渤海汇金证券资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	麻众志	王小飞
	联系电话	010-68784289	021-60637103
	电子邮箱	mazz@bhzq.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-651-5988/ 400-651-1717	021-60637228
传真		022-23861651	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市前海深港合作区桂	北京市西城区闹市口大街 1 号

	湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	院 1 号楼
邮政编码	518054	100033
法定代表人	齐朝晖	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	https://www.bhhjamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	渤海汇金证券资产管理有限公司	天津市南开区宾水西道 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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	35,312,144.14	19,655,350.94	874,689.31
本期利润	33,616,478.95	24,074,958.47	1,644,835.92
加权平均基金份额本期利润	0.0337	0.0448	0.0467
本期加权平均净值利润率	3.33%	4.42%	4.60%
本期基金份额净值增长率	3.38%	4.29%	0.49%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	15,208,451.68	4,531,176.10	4,676,483.10
期末可供分配基金份额利润	0.0152	0.0045	0.0197
期末基金资产净值	1,012,563,174.46	1,001,887,972.20	241,791,620.85
期末基金份额净值	1.0152	1.0045	1.0197
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	10.95%	7.32%	2.91%

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。

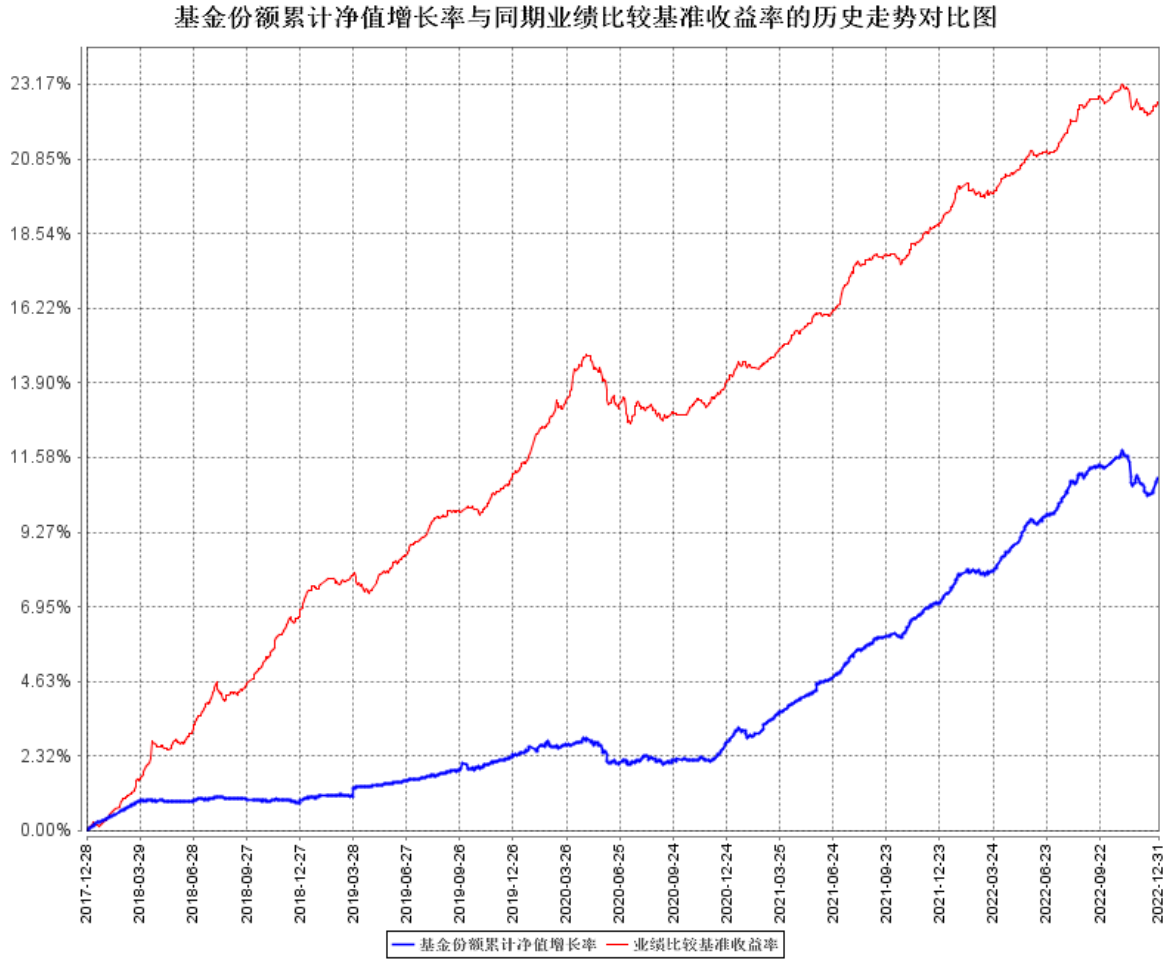
3.2 基金净值表现

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	-0.27%	0.08%	0.06%	0.06%	-0.33%	0.02%
过去六个月	1.01%	0.06%	1.31%	0.05%	-0.30%	0.01%
过去一年	3.38%	0.05%	2.94%	0.05%	0.44%	0.00%
过去三年	8.35%	0.04%	10.33%	0.06%	-1.98%	-0.02%
过去五年	10.90%	0.03%	22.56%	0.05%	-11.66%	-0.02%
自基金合同生效起至今	10.95%	0.03%	22.64%	0.05%	-11.69%	-0.02%

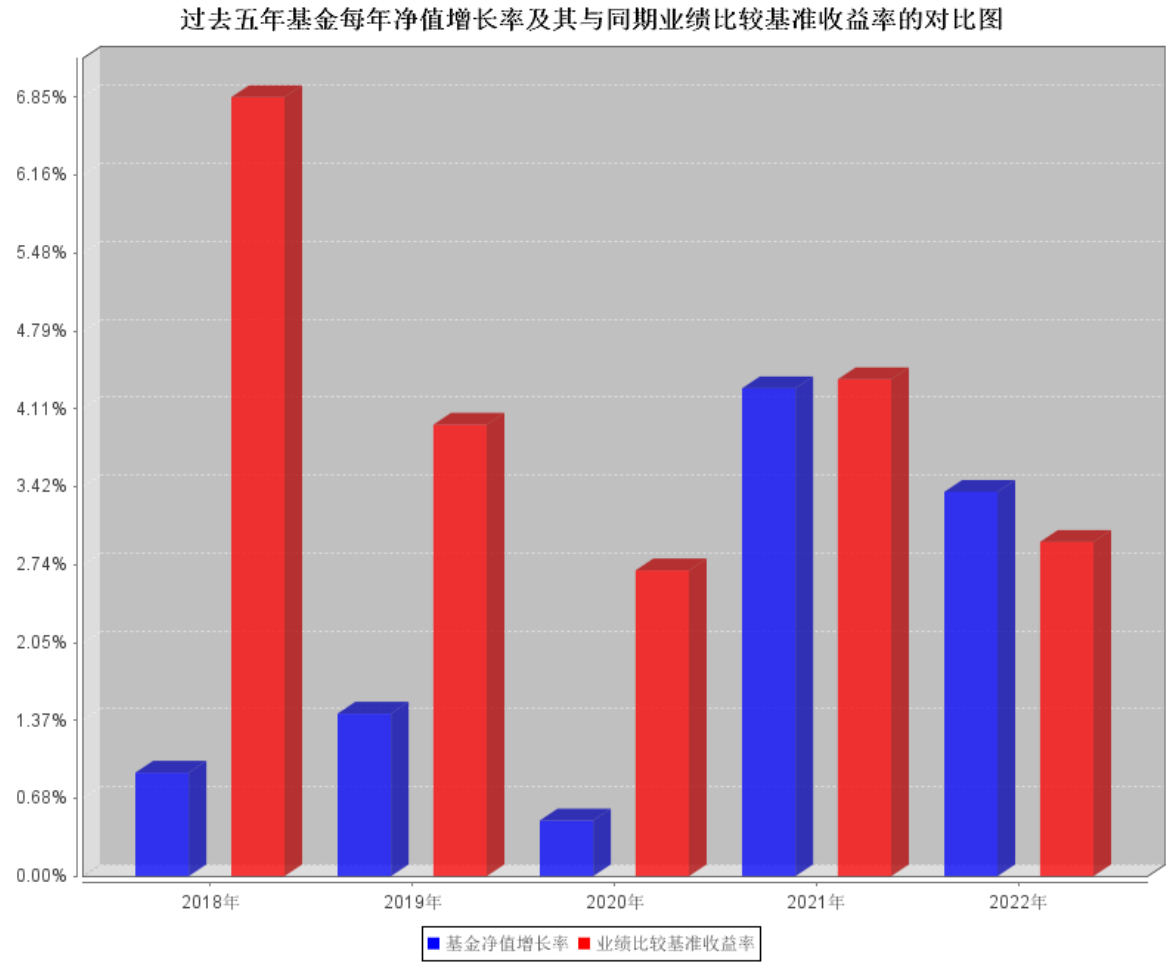
注：业绩比较基准：中债综合指数(总财富)收益率×80%+1 年期定期存款利率(税后)×20%

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



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 过去五年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 2017 年 12 月 28 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
2022	0.230	22,939,180.99	-	22,939,180.99	
2021	0.578	33,991,550.24	-	33,991,550.24	
2020	-	-	-	-	
合计	0.808	56,930,731.23	-	56,930,731.23	

§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 12 月 31 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、渤海汇金 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、渤海汇金低碳经济一年持有期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	2017 年 12 月 28 日	-	6 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 月起至 2022 年 1 月任渤海汇金汇增利 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。2022 年 6 月起任渤海汇金兴宸一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
周珂	本基金的基金经理	2021 年 1 月 28 日	-	2 年	北京大学硕士研究生学历，自从业以来一直从事固收投资管理工作。2008 年 7 月至 2014 年 11 月就职于中国投融资担保股份有限公司，担任固收投资经理。2014 年 11 月至 2017 年 4 月就职于昆仑银行股份有限公司，担任固收投资经理。2017 年 4 月至 2019 年 7 月就职于中信保诚人寿保险有限公司，担任固收投资经理岗位。2019 年 8 月至 2020 年 8 月就职于和谐健康保险股份有限公司资产管理部，担任固收投资负责人。2020 年 9 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司，担任公募投资部固收投资副总监，负责公募产品投资管理相关工作，2021 年 1 月起任渤海汇金汇添益 3 个月定

					期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 2 月起任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2022 年 11 月起任渤海汇金 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券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

2022 年，由于疫情反复下经济下行压力增大，货币政策整体运行平稳、宽松，资金利率中枢基本低于政策利率。央行今年通过再贷款等结构性货币政策工具使得货币政策在总量与结构两个方面发挥调节作用。公开市场操作方面，央行在今年 1 月和 8 月两次调降政策利率 10BP，公开市场日常数量较小，在月末年末则加大投放平抑资金波动，本年度公开市场操作全年净投放 10280 亿元。债券市场方面，整体来看 2022 年上半年债市多空因素交织债市窄幅震荡，下半年债市超预期下跌。上半年经济复苏收到疫情反复影响，央行延续了降准降息的宽松货币政策，资金面持续宽松下债市利率处于低位，7-8 月份超预期充裕的资金面、经济复苏预期转弱加上 8 月的超预期降息共同作用下使得利率不断下行，十年期国债利率触底到 2.58%的本年度年内低位。但是进入 11 月之后，防疫措施趋于宽松调整叠加经济稳增长政策密集出台，债市市场大跌，利率不断攀升，十年期国债利率于 12 月中旬触及 2.92%的 2022 年内高点。报告期内本基金的主要投资思路注重信用挖掘，挖掘价值低估债券获取价值重估收益；保持一定杠杆幅度，获取稳定票息收益和杠杆套利收益；同时，在市场波动较大时通过利率债和金融债的波段操作增厚产品收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0152 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.38%，业绩比较基准收益率为 2.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度，当前基本面偏弱未来一段时间仍是政策呵护下经济修复的环境，经济短期仍处于防疫政策调整后的适应期；货币政策仍将以我为主，货币政策主基调仍较为宽松且更加注重定向精准。本基金将根据债市走势，灵活调整持仓资产品种和久期；信用债投资方面保持较高的套息比例，利率债投资方面以博取超跌反弹的短线机会参与交易。具体标的方向以城投债为主，产

业债为辅，主要考虑国企债。期限和杠杆水平根据市场调整节奏，相机决策。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

公司稽核工作接受党总支和董事会的领导和监督。对公司各部门财务收支、经济活动和员工执业行为进行了若干离任稽核、组织开展全面风险管理评估、合规管理有效性评估、专项稽核（2022 年度反洗钱稽核项目）以及季度监察报表等工作，通过外聘会计师事务所开展公司年度投行内控有效性评估的工作。

报告期内，公司监察稽核工作整体平稳开展，根据监管变化和基金业务开展情况，适时调整工作安排，提高监察稽核工作质量，明确监察稽核各业务环节工作职责，规范稽核工作程序，加强对公司各业务条线、各部门的管理和监督，防范和控制风险，改善公司的经营管理情况。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《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合同》及其他相关法

律法规的规定，本报告期内，本基金进行了 1 次分红。以 2022 年 5 月 18 日为收益分配基准日，可供分配利润为 23,614,524.91 元，2022 年 5 月 24 日进行权益登记、除息，2022 年 5 月 25 日向渤海汇金汇添益 3 个月定开基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.230 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 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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(23)第 P02051 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“渤海汇金汇添益 3 个月定开基金”)的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则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添益 3 个月定开基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于渤海汇金汇添益 3 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	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添益 3 个月定开基金 2022 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。 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。 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。 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。

管理层和治理层对财务报表的责任	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。 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添益 3 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添益 3 个月定开基金、终止经营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督渤海汇金汇添益 3 个月定开基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。

	(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (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。 (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添益 3 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添益 3 个月定开基金不能持续经营。 (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。 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。
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	杨小真　　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	2023 年 3 月 24 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：渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日： 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	7,560,086.31	930,431.38
结算备付金		-	228,719.05
存出保证金		7,078.66	2,790.52
交易性金融资产	7.4.7.2	907,382,271.98	1,148,827,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		899,967,705.22	1,100,113,000.00
资产支持证券投资		7,414,566.76	48,714,000.00
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	98,062,636.94	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	15,584,607.46
资产总计		1,013,012,073.89	1,165,573,548.41
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2022 年 12 月 31 日**	**上年度末 2021 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	162,999,235.50
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		124,449.61	255,950.26
应付托管费		41,483.20	85,316.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		77,859.86	105,303.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	205,106.76	239,770.25
负债合计		448,899.43	163,685,576.21
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	997,354,722.78	997,356,796.10
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	15,208,451.68	4,531,176.10
净资产合计		1,012,563,174.46	1,001,887,972.20
负债和净资产总计		1,013,012,073.89	1,165,573,548.41

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0152 元，基金份额总额 997,354,722.78 份。

2、以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用” 、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末余额 。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期： 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		41,999,202.27	28,525,162.95
1.利息收入		263,562.70	21,948,711.69
其中：存款利息收入	7.4.7.13	9,455.10	7,116.17
债券利息收入		-	20,644,640.50
资产支持证券利息收入		-	1,259,395.00
买入返售金融资产收入		254,107.60	37,560.02
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		43,431,304.76	2,156,551.73
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	42,650,628.24	2,113,614.20
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	780,676.52	42,937.53
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	-	-
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）	7.4.7.20	-1,695,665.19	4,419,607.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	292.00
减：二、营业总支出		8,382,723.32	4,450,204.48
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	2,607,005.10	1,391,931.36
2．托管费	7.4.10.2.2	869,001.66	463,977.06
3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		4,602,127.77	2,298,161.85
其中：卖出回购金融资产支出		4,602,127.77	2,298,161.85
6．信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		103,221.44	56,432.92
8．其他费用	7.4.7.23	201,367.35	239,701.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,616,478.95	24,074,958.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,616,478.95	24,074,958.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		33,616,478.95	24,074,958.47

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期

	2022年1月1日至2022年12月31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）	997,356,796.10	-	4,531,176.10	1,001,887,972.20
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）	997,356,796.10	-	4,531,176.10	1,001,887,972.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,073.32	-	10,677,275.58	10,675,202.26
（一）、综合收益总额	-	-	33,616,478.95	33,616,478.95
（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）	-2,073.32	-	-22.38	-2,095.70
其中：1.基金申购款	146.46	-	3.27	149.73
2.基金赎回款	-2,219.78	-	-25.65	-2,245.43
（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）	-	-	-22,939,180.99	-22,939,180.99
（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）	997,354,722.78	-	15,208,451.68	1,012,563,174.46
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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）	237,115,137.75	-	4,676,483.10	241,791,620.85
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）	237,115,137.75	-	4,676,483.10	241,791,620.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	760,241,658.35	-	-145,307.00	760,096,351.35
（一）、综合收益总额	-	-	24,074,958.47	24,074,958.47
（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）	760,241,658.35	-	9,771,284.77	770,012,943.12
其中：1.基金申购款	760,241,832.86	-	9,771,286.89	770,013,119.75
2.基金赎回款	-174.51	-	-2.12	-176.63
（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）	-	-	-33,991,550.24	-33,991,550.24
（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）	997,356,796.10	-	4,531,176.10	1,001,887,972.20

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证

券监督管理委员会证监许可[2017]第 1069 号《关于准予渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券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 69,999,500.00 元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 1128 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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合同》于 2017 年 12 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 69,999,500.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 0.00 份基金份额。本基金的基金管理人为渤海汇金证券资产管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券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良好流动性的金融工具，包括债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券、可分离债券的纯债部分、可交换债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单等货币市场工具，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)。本基金不主动买入股票、权证等权益类资产，投资可转换债券、可交换债时不进行转股操作。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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

本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 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期每个交易日日终，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为：中债综合指数(总财富)收益率×80%+1 年期定期存款利率(税后)×20%。

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 2023 年 3 月 24 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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况以及2022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

-

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

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

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

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

(2)金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认

后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，

且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，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净

值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2)投资收益

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除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，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

(3)公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4)信用减值损失

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

7.4.4.10 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或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 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

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) 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) 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，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 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债

券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据《关于发布<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>的通知》(中基协发[2014]24 号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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 2022 年度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。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、卖出回购金融资产款和应付利息，人民币 930,431.38 元、人民币 228,719.05 元、人民币 2,790.52 元、人民币 185.32 元、人民币 162,999,235.50 元和人民币 44,470.48 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。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，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、和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。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息的金额分别为人民币 930,502.19 元、人民币 228,832.24 元、人民币 2,791.84 元、人民币 0.00 元、人民币 163,043,705.98 元和人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资

产，金额为人民币 1,148,827,000.00 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 15,584,422.14 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 1,164,411,422.14 元。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]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项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	7,560,086.31	930,431.38
等于：本金	7,559,122.96	930,431.38
加：应计利息	963.35	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计：	7,560,086.31	930,431.38

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	49,367,638.35	1,230,439.45	51,257,439.45	659,361.65
	银行间市场	834,398,449.20	11,480,165.77	848,710,265.77	2,831,650.80
	合计	883,766,087.55	12,710,605.22	899,967,705.22	3,491,012.45
资产支持证券		7,386,000.00	22,566.76	7,414,566.76	6,000.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		891,152,087.55	12,733,171.98	907,382,271.98	3,497,012.45

项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	49,367,638.35	-	49,199,000.00	-168,638.35
	银行间市场	1,045,552,684.01	-	1,050,914,000.00	5,361,315.99
	合计	1,094,920,322.36	-	1,100,113,000.00	5,192,677.64
资产支持证券		48,714,000.00	-	48,714,000.00	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,143,634,322.36	-	1,148,827,000.00	5,192,677.64

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	98,062,636.94	-
合计	98,062,636.94	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

-

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	15,584,607.46
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	15,584,607.46

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	45,806.76	36,299.77
其中：交易所市场	-	7,706.91
银行间市场	45,806.76	28,592.86
-	-	-
应付利息	-	44,470.48
预提费用	159,300.00	159,000.00
合计	205,106.76	239,770.25

7.4.7.10 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	997,356,796.10	997,356,796.10
本期申购	146.46	146.46
本期赎回（以“-”号填列）	-2,219.78	-2,219.78
- 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	997,354,722.78	997,354,722.78

注：(1)申购含转换入份额，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。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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	10,503,137.70	-5,971,961.60	4,531,176.10
本期利润	35,312,144.14	-1,695,665.19	33,616,478.95
本期基金份额交易产生的变动数	-35.57	13.19	-22.38
其中：基金申购款	3.09	0.18	3.27
基金赎回款	-38.66	13.01	-25.65
本期已分配利润	-22,939,180.99	-	-22,939,180.99
本期末	22,876,065.28	-7,667,613.60	15,208,451.68

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	9,130.97	6,582.95
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	289.07	522.24
其他	35.06	10.98
合计	9,455.10	7,116.17

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无股票投资收益—证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	43,162,917.50	-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-512,289.26	2,113,614.20
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	42,650,628.24	2,113,614.20

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,687,476,266.59	1,003,206,015.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,642,372,311.67	981,032,802.23
减：应计利息总额	45,576,840.78	20,059,599.56
减：交易费用	39,403.40	-
买卖债券差价收入	-512,289.26	2,113,614.20

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.15.4 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。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	780,676.52	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	42,937.53
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	780,676.52	42,937.53

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12

	月31日	月31日
卖出资产支持证券成交总额	42,275,591.71	82,702,485.34
减：卖出资产支持证券成本总额	41,328,000.00	81,243,062.47
减：应计利息总额	947,591.71	1,416,485.34
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	42,937.53

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

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

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 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。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.18.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.19 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。

7.4.7.20 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	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
1.交易性金融资产	-1,695,665.19	4,419,607.53
——股票投资	-	-
——债券投资	-1,701,665.19	4,240,670.00
——资产支持证券投资	6,000.00	178,937.53
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-1,695,665.19	4,419,607.53

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	0.33
其他	-	291.67
合计	-	292.00

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他费用	300.00	32,307.84
银行汇划费用	13,867.35	21,293.45
银行间账户维护费	37,200.00	36,100.00
合计	201,367.35	239,701.29

7.4.7.24 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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、基金销售机构

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

本基金开展的债券交易、债券回购交易均由本基金管理人渤海汇金资管行使投资人权利，并通过本基金管理人的独资股东渤海证券的交易席位进行。本基金的银行存款均存放于本基金托管人建设银行。上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
渤海证券	166,600,067.06	100.00%	74,538,508.76	100.00%

7.4.10.1.3 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	34,000,000.00	100.00%	28,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 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12月31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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	8,206.77	100.00%	7,706.91	100.00%

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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,607,005.10	1,391,931.36
其中：支付销售机构的客户维护费	10.95	9.24

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 0.3%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×0.3%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	869,001.66	463,977.06

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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转融通证券出借业务的重大关联交易事项。

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：无。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金合同生效日（ 2017 年 12 月 28 日 ）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
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	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.00%	1.00%

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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.5.3 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
建设银行	7,560,086.31	9,130.97	930,431.38	6,582.95

注：本基金的活期银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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	2022 年 5 月 24 日	-	2022 年 5 月 24 日	0.230	22,939,180.99	-22,939,180.99		
合计	-	-		0.230	22,939,180.99	-22,939,180.99		

7.4.12 期末（ 2022 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

本基金本报告期末未持有银行间债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购。

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 3 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	80,388,243.29	-
A-1 以下	-	-
未评级	311,541,646.58	260,752,000.00
合计	391,929,889.87	260,752,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为短期融资券等无债项评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	-	15,118,000.00
合计	-	15,118,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级资产支持证券为短期无债项评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	9,697,000.00
合计	-	9,697,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，同业存单无债项评级。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	270,639,988.21	511,636,000.00
AAA 以下	166,454,862.03	-
未评级	70,942,965.11	318,028,000.00
合计	508,037,815.35	829,664,000.00

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	7,414,566.76	33,596,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	7,414,566.76	33,596,000.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级。

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 2022 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债的合约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(于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款人民币 162,999,235.50 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约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 163,841,222.90 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时间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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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。

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2022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	7,559,122.96	-	-	-	963.35	7,560,086.31
存出保证金	7,075.14	-	-	-	3.52	7,078.66
交易性金融资产	467,957,500.00	264,485,000.00	162,206,600.00	-	12,733,171.98	907,382,271.98
买入返售金融资产	98,040,547.06	-	-	-	22,089.88	98,062,636.94
其他资产	-	-	-	-	-	-
资	573,564,245.1	264,485,000.0	162,206,600.0	-	12,756,228.7	1,013,012,073.8

产总计	6	0	0		3	9
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	124,449.61	124,449.61
应付托管费	-	-	-	-	41,483.20	41,483.20
应交税费	-	-	-	-	77,859.86	77,859.86
其他负债	-	-	-	-	205,106.76	205,106.76
负债总计	-	-	-	-	448,899.43	448,899.43
利率敏感度缺口	573,564,245.16	264,485,000.00	162,206,600.00	-	12,307,329.30	1,012,563,174.46
上年度末2021年12月31	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

日						
资产						
银行存款	930,431.38	-	-	-	-	930,431.38
结算备付金	228,719.05	-	-	-	-	228,719.05
存出保证金	2,790.52	-	-	-	-	2,790.52
交易性金融资产	244,399,000.00	205,222,000.00	583,225,000.00	115,981,000.00	-	1,148,827,000.00
应收利息	-	-	-	-	15,584,607.46	15,584,607.46
资产总计	245,560,940.95	205,222,000.00	583,225,000.00	115,981,000.00	15,584,607.46	1,165,573,548.41
负债						
卖出回购金融资产款	162,999,235.50	-	-	-	-	162,999,235.50
应付	-	-	-	-	255,950.26	255,950.26

管理人报酬						
应付托管费	-	-	-	-	85,316.74	85,316.74
应付交易费用	-	-	-	-	36,299.77	36,299.77
应付利息	-	-	-	-	44,470.48	44,470.48
应交税费	-	-	-	-	105,303.46	105,303.46
其他负债	-	-	-	-	159,000.00	159,000.00
负债总计	162,999,235.50	-	-	-	686,340.71	163,685,576.21
利率敏感度缺口	82,561,705.45	205,222,000.00	583,225,000.00	115,981,000.00	14,898,266.75	1,001,887,972.20

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2022 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2021 年 12 月 31 日 ）
	1. 市场利率上升 25 个基点	-2,653,806.92	-6,139,253.16
	2. 市场利率下降 25 个基点	2,675,082.93	6,193,204.90

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 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 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	907,382,271.98	1,148,827,000.00
第三层次	-	-
合计	907,382,271.98	1,148,827,000.00

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	907,382,271.98	89.57
	其中：债券	899,967,705.22	88.84
	资产支持证券	7,414,566.76	0.73
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	98,062,636.94	9.68
	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	7,560,086.31	0.75
8	其他各项资产	7,078.66	0.00
9	合计	1,013,012,073.89	100.00

8.2 报告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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,942,965.11	7.01
	其中：政策性金融债	70,942,965.11	7.01
4	企业债券	61,466,266.96	6.07
5	企业短期融资券	391,929,889.87	38.71
6	中期票据	375,628,583.28	37.10
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	899,967,705.22	88.88

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	042280551	22 河钢集 CP002	800,000	80,388,243.29	7.94
2	012283684	22 国网租赁 SCP018	800,000	80,258,047.12	7.93
3	200217	20 国开 17	500,000	50,164,652.78	4.95
4	012284042	22 武清经开 SCP007	500,000	49,674,041.10	4.91
5	101800592	18 津城建 MTN011B	400,000	41,426,660.82	4.09

8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	136769	徐租 15A1	300,000	7,414,566.76	0.73

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

不适用。

8.10.2 本期国债期货投资评价

不适用。

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	7,078.66
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,078.66

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
201	4,961,963.79	997,354,722.78	100.00%	-	0.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：无

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。

9.5 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	10,000,000.00	1.00	10,000,000.00	1.00	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	1.00	10,000,000.00	1.00	自合同生效之日起不少于三年

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2017 年 12 月 28 日 ）基金份额总额	69,999,500.00
本报告期期初基金份额总额	997,356,796.10
本报告期基金总申购份额	146.46
减:本报告期基金总赎回份额	2,219.78
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	997,354,722.78

§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 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。

3、本基金管理人于 2022 年 10 月 20 日发布公告，自 2022 年 10 月 18 日起，齐朝晖先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的董事长，原董事长刘嫣女士离任。

4、本基金管理人于 2022 年 10 月 20 日发布公告，管理人股东单位委派齐朝晖、马彦平、刘嫣、麻众志、邹晖为公司第三届董事会董事，委派刘彤为第三届监事，方超、盛况、赵猛不再担任公司董事职务。管理人第三届董事会选举齐朝晖为公司董事长，选举刘嫣为公司副董事长。

5、基金管理人于 2022 年 12 月 22 日发布公告，经股东渤海证券股份有限公司研究决定委派何青先生为公司第三届董事会独立董事，任期与第三届董事会相同。经基金管理人 2022 年第二次职工大会选举产生刘鸿羽先生为公司职工监事。

6、本基金管理人于 2022 年 12 月 31 日发布公告，自 2022 年 12 月 30 日起，王怡强先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的首席风险官，原首席风险官李颖女士离任。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为其审计机构。本报告期应支付德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 30,000.00 元。截至本报告期末，该审计机构已为本基金

提供审计服务 1 年 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受到稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生托管人及其高级管理人员受到稽查或处罚的情况。

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	
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、报告的及时性及服务质量；交易佣金收费合理。

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

3、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
渤海证券	166,600,067.06	100.00%	34,000,000.00	100.00%	-	-

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	2021年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（副总经理）变更公告	公司网站、中国证券报	2022 年 1 月 1 日
2	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	公司网站	2022 年 1 月 1 日
3	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报	2022 年 1 月 4 日
4	关于渤海汇金证券资产管理有限公司董事会成员变更的公告	公司网站	2022 年 1 月 11 日
5	关于渤海汇金证券资产管理有限公司董事会成员变更的公告	中国证券报	2022 年 1 月 12 日
6	渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金2021年第 4 季度报告	公司网站	2022 年 1 月 24 日
7	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金2021年第4季度报告的提示性公告	中国证券报	2022 年 1 月 24 日
8	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第十四个开放期开放申购、赎回业务的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 1 月 28 日
9	关于旗下部分基金增加北京中植	公司网站、中国证券报	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		
10	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2021年年度报告	公司网站	2022 年 3 月 31 日
11	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告的提示性公告	中国证券报	2022 年 3 月 31 日
12	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2022年第 1 季度报告	公司网站	2022 年 4 月 22 日
13	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金2022年第1季度报告的提示性公告	中国证券报	2022 年 4 月 22 日
14	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第十五个开放期开放申购、赎回业务的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 13 日
15	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产品资料概要（更新）	公司网站	2022 年 5 月 13 日
16	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招募说明书（更新）（2022 年第 1 号）	公司网站	2022 年 5 月 13 日
17	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下 8 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	中国证券报	2022 年 5 月 13 日
18	渤海汇金汇添益 3 个月定期开放	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 24 日

	债券型发起式证券投资基金分红公告		
19	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 31 日
20	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加中正达广基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 31 日
21	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 6 月 2 日
22	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、中国证券报	2022 年 6 月 28 日
23	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 7 月 4 日
24	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 2022 年第 2 季度报告	公司网站	2022 年 7 月 21 日
25	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证券报	2022 年 7 月 21 日

26	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 8 月 11 日
27	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第十六个开放期开放申购、赎回业务的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 8 月 23 日
28	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2022年中期报告	公司网站	2022 年 8 月 31 日
29	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告的提示性公告	中国证券报	2022 年 8 月 31 日
30	关于渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金提前结束第十六个开放期的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 9 月 14 日
31	2022年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（董事长）变更公告	公司网站、中国证券报	2022 年 10 月 20 日
32	渤海汇金证券资产管理有限公司关于董事、监事变更的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 10 月 20 日
33	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2022年第 3 季度报告	公司网站	2022 年 10 月 26 日
34	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金2022年第3季度报告的提示性公告	中国证券报	2022 年 10 月 26 日
35	渤海汇金证券资产管理有限公司	公司网站、中国证券报	2022 年 11 月 9 日

	关于旗下部分基金增加泛华普益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		
36	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第十七个开放期开放申购、赎回业务的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 12 月 14 日
37	渤海汇金证券资产管理有限公司增聘独立董事及选举职工监事的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 12 月 22 日
38	关于渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金延长第十七个开放期的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 12 月 29 日
39	2022 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（首席风险官）变更公告	公司网站、中国证券报	2022 年 12 月 31 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	20220101-20221231	987,343,175.88	0.00	0.00	987,343,175.88	99.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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： 1.单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。 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。 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。 4.单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。							

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添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件；

2、《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合同》；

3、《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托管协议》；

4、《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招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

6、渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式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

2023 年 3 月 31 日