

# 渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 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：中泰证券股份有限公司

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。

基金托管人中泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	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.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	56
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.....	57
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.....	63

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 .....	63
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
8.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>66</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
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 .....	66
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 .....	66
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
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 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>77</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	77
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>78</b>
13.1 备查文件目录 .....	78
13.2 存放地点 .....	78
13.3 查阅方式 .....	78

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金
基金简称	渤海汇金新动能主题混合
场内简称	-
基金主代码	010584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年3月23日
基金管理人	渤海汇金证券资产管理有限公司
基金托管人	中泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	34,178,212.14份
基金合同存续期	-
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

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

	<p>2) 通过发展新型能源、新型材料、新型生产工艺或构造新生产模式, 在传统产业中对排放结构进行绿色化、低碳化、循环化的升级, 或在传统产业中产业结构方面进行高端化、集群化、品牌化、信息化和智能化等转型的企业, 在申银万国一级行业中相关行业包括: 电力设备、机械设备、汽车、有色金属、基础化工、公用事业、环保;</p> <p>3) 在包括医疗、教育、文化、娱乐等中高端消费中着力提升消费服务水平, 或利用大数据等手段积极创造新兴业态模式的企业, 在申银万国一级行业中相关的行业包括: 医药生物、传媒、家用电器等。</p> <p>未来随着科学技术变革和产业结构升级, 本基金界定的新动能主题的范围会发生扩大或者变化, 本基金将在履行适当程序后适时调整上述主题的界定。</p> <p>(三) 股票投资策略</p> <p>本基金通过对公司及行业所处的基本面进行深入分析和把握, 结合个股定量指标自下而上的精选新动能主题相关股票构建投资组合。</p> <p>1、定量分析</p> <p>本基金将从估值水平、盈利能力、运营质量等定量指标方面对拟投资对象进行评估, 挑选出新动能主题内优质的上市公司股票。</p> <p>1) 估值水平</p> <p>本基金结合市场、行业与个股的估值水平来挖掘具备估值优势的上市公司, 可供选择的估值指标包括市盈率 (P/E)、市净率 (P/B)、市盈增长比率 (PEG)、自由现金流贴现 (FCFF, FCFE) 和企业价值 EV/EBITDA 等。</p> <p>2) 成长性</p> <p>本基金通过成长性指标分析评估上市公司的历史成长状况, 主要参考的指标包括收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等。</p> <p>3) 运营质量</p> <p>本基金通过运营质量指标考察上市公司的内部管理质量, 主要参考的指标包括存货周转率、应收账款周转率、每股经营现金流等。</p> <p>2、定性分析</p> <p>本基金在定量分析选取出的股票基础上, 深入研究公司的基本面, 从公司的核心竞争优势、持续成长能力等方面精选上市公司股票, 进行股票组合的构建并适时进行调整。</p> <p>1) 核心竞争优势。重点考察公司在市场地位、技术研发水平、产品定价能力、资源禀赋、激励制度等方面的特征, 选取具有独特竞争优势的优质企业。</p> <p>2) 持续成长能力。在对公司未来主营业务收入增长率</p>
--	--

和净利润增长率分析研判的基础上，选择在较长期限内实现可持续增长的新动能主题上市公司。

#### （四）债券投资策略

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

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

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

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

#### （五）股指期货、国债期货投资策略

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

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

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

#### （六）资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济等多个因素的研究预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时在严格控制风险的情况下，综合运用多个策

	略和研究方法，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		渤海汇金证券资产管理有限公司	中泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	麻众志	王秀荣
	联系电话	010-68784289	0531-68889484
	电子邮箱	mazz@bhjq.com	wangxr01@zts.com.cn
客户服务电话		400-651-5988/ 400-651-1717	95538
传真		022-23861651	0531-68889445
注册地址		深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	山东省济南市经七路 86 号
办公地址		深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	山东省济南市经七路 86 号证券大厦 10 楼 1006 室
邮政编码		518054	250001
法定代表人		齐朝晖	王洪

### 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	<a href="https://www.bhhjamc.com">https://www.bhhjamc.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 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 3 月 23 日 (基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	2020 年
本期已实现收益	-12,795,349.71	12,855,535.95	-
本期利润	-14,866,518.59	13,394,822.51	-
加权平均基金份额本期利润	-0.3391	0.1362	-
本期加权平均净值利润率	-39.37%	12.88%	-
本期基金份额净值增长率	-30.65%	5.42%	-
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	-9,191,397.67	2,768,239.67	-
期末可供分配基金份额利润	-0.2689	0.0542	-
期末基金资产净值	24,986,814.47	53,803,941.67	-
期末基金份额净值	0.7311	1.0542	-
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	-26.89%	5.42%	-

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

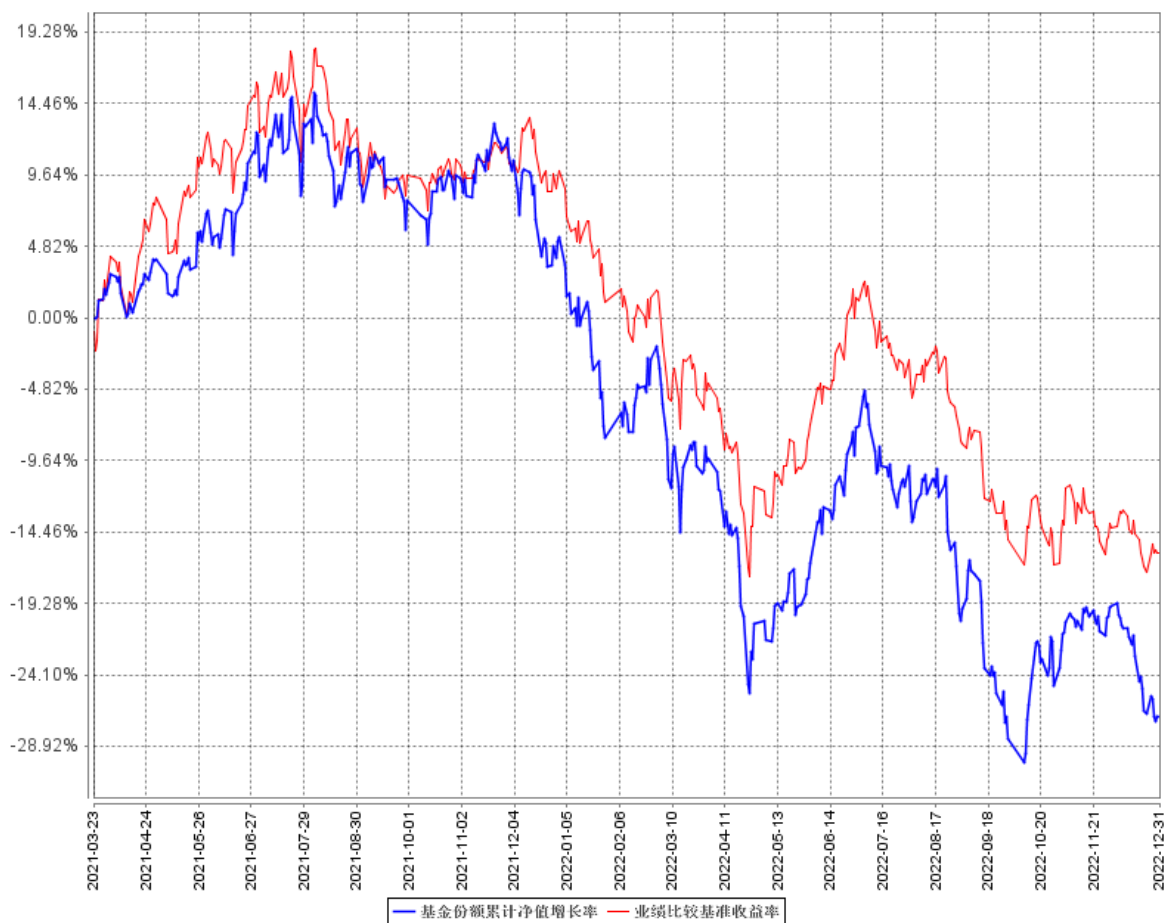
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.19%	1.30%	-1.07%	1.08%	3.26%	0.22%
过去六个月	-21.05%	1.38%	-17.00%	1.02%	-4.05%	0.36%
过去一年	-30.65%	1.49%	-23.51%	1.18%	-7.14%	0.31%
自基金合同生效起至今	-26.89%	1.32%	-15.90%	1.11%	-10.99%	0.21%

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

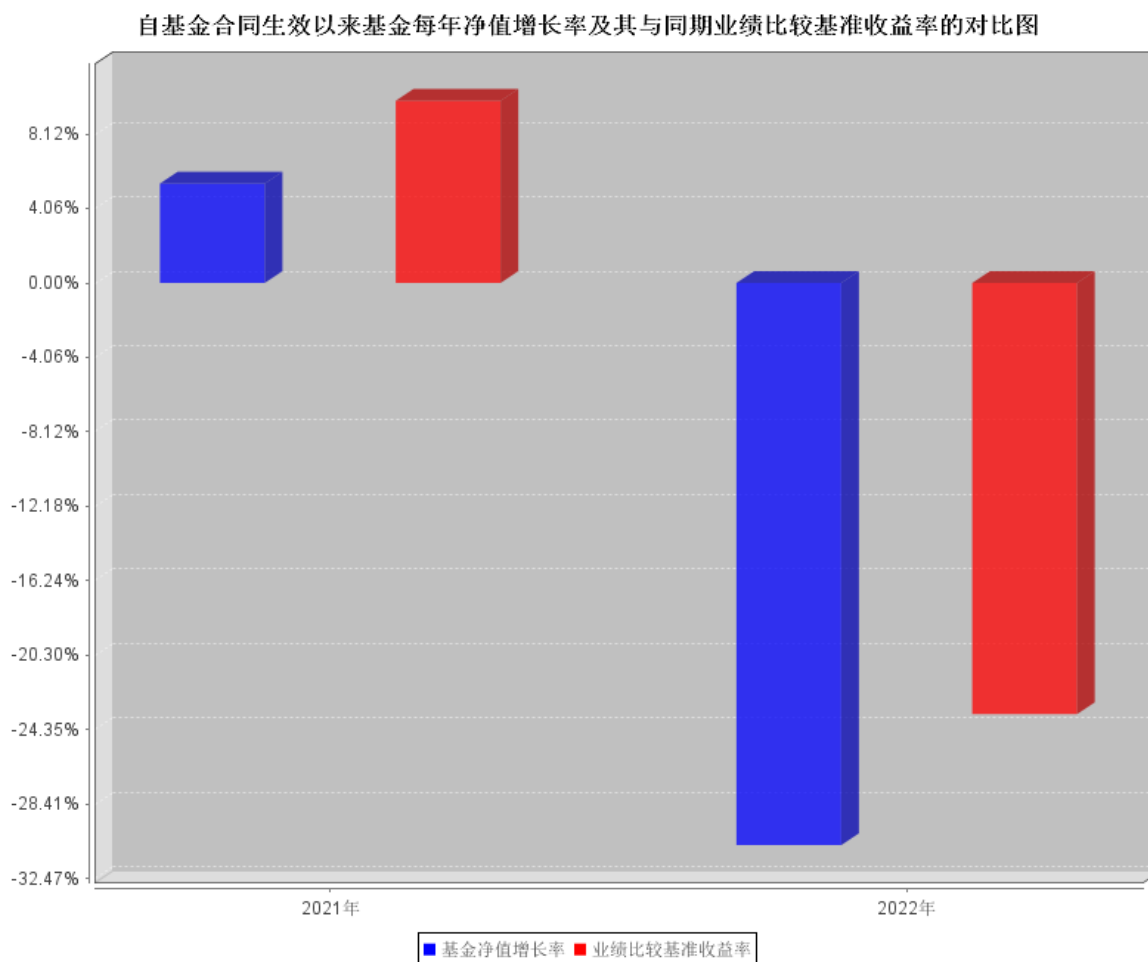
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

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



注：本基金合同于 2021 年 3 月 23 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

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		
何翔	本基金的基金经理、公募投资总监、公募投资部总经理	2021年3月23日	-	19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月至

					2022 年 11 月担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。2021 年 3 月起任渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 28 日起任渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金经理
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

#### 4.1.4 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《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 年国内外环境错综复杂，A 股市场跌宕起伏。年初的俄乌冲突扰乱了全球能源供应与政治经济格局，美联储大幅加息导致全球流动性紧张进而令全球资本市场承压。国内疫情持续反复叠加地产周期下行、需求疲弱令经济增长困难重重。A 股市场风险偏好急剧下降，整体估值水平大幅回落。直至 11 月在国内疫情防控政策的优化，地产政策及货币政策的持续出台改善了市场预期，提振了市场信心，A 股市场开启修复之路。截至 2022 年底，上证指数、沪深 300、中证 500、创业板指全年分别下跌 15.13%、21.63%、20.31%、29.37%。行业方面，仅煤炭和综合两个行业上涨，其余行业均呈现不同程度下跌，跌幅居前五的行业为电子、建筑材料、传媒、计算机、电力设备。

2022 年，我们锚定中国新经济新动能的长期确定性方向，努力挖掘基本面优质、成长性较好的标的。在新动能主题的选股空间内基于多策略量化模型构建股票组合，并根据市场变化对投资组合进行动态跟踪调整，力求持续挖掘新动能主题方向下的阿尔法收益。但在需求收缩、供给冲击、预期减弱的三重压力下市场信心匮乏，导致 2022 年许多新兴产业领域的板块出现大幅调整，这对新动能基金净值形成较大的负面冲击。面对经济下行阶段在市场预期和情绪助推下经济新动能方向、新兴产业领域标的大幅波动，我们一方面坚信受益于产业升级、政策支持的基本面优质、成长性较高的标的仍然具有中长期持续性优势，另一方面我们持续优化改进选股策略，力争进一步提升策略的适应性和超额收益稳定性。

#### 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 0.7311 元；本报告期基金份额净值增长率为-30.65%，业绩比较基准收益率为-23.51%。

#### 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 2023 年，国内方面，防疫政策优化和地产支持发力，中央政治局会议和中央经济工作会议注重稳经济的政策导向强化了市场对于中期基本面改善的预期。海外方面，随着美国经济衰退压力进一步加强，美联储将开启紧缩退坡的进程，美债利率筑顶回落，人民币兑美元有望逐渐走强，有利于 A 股估值修复。市场方面，A 股估值水平仍处于低位具有较好的安全边际，股债性价比也显示 A 股市场的中长期配置价值凸显。在防疫政策的优化、稳增长政策持续落地，全球流动性及地缘冲突边际缓解的推动下 2023 年我们将迎来经济逐步的复苏。因此对于 2023 年市场我们认为可以更加乐观，除受益于疫情缓解、地产修复的复苏交易方向，具有政策支持、具备高景气 and 竞争力的中小成长方向在 2023 年温和复苏的大环境下也会有更好的表现，尤其市场关注度较低、具备估值和成长优势的一些中小股票会存在定价偏差，具备很好的结构性机会。

基于上述市场预期分析以及新动能的主题基金特性，2023 年新动能将积极把握 A 股市场布局良机，以政策支持、业绩驱动为主线，将积极把握 A 股市场布局良机，以政策支持、业绩驱动为主线，聚焦科技创新、先进制造、国家安全、绿色低碳等政策支持重点领域以及扩大内需政策助推下消费复苏方向，持续挖掘新动能主题方向下具有政策支持、估值优势，更具业绩弹性和成长空间的优质标的，重点把握好 2023 年经济温和复苏环境下中小盘股的结构性的机会，力争为投资者获取长期稳定投资收益。

#### 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。

#### 4.9 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

本基金报告期内，未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况。本基金自 2022 年 1 月 20 日至 2022 年 4 月 5 日连续 47 个工作日、2022 年 4 月 11 日至 2022 年 6 月 20 日连续 47 个工作日，以及 2022 年 6 月 23 日至 2022 年 12 月 31 日连续 131 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人已向中国证监会报告，鉴于本基金的运作情况，基金管理人的解决方案为：将不断完善已有持营方案，加大对本基金的持续营销。



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人的投资运作进行了监督，对基金净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

## § 6 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 P02049 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	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金(以下简称“渤海汇金新动能主题混合基金”)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。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了渤海汇金新动能主题混合基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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新动能主题混合基金,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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>渤海汇金证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括渤海汇金新动能主题混合基金 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。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估渤海汇金新动能主题混合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新动能主题混合基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督渤海汇金新动能主题混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的</p>

	<p>并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对渤海汇金新动能主题混合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新动能主题混合基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	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：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,063,589.99	4,017,224.88
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	23,125,242.63	47,838,399.30
其中：股票投资		23,024,928.00	47,809,528.70
基金投资		-	-
债券投资		100,314.63	28,870.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	2,000,000.00
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		2,219.84	163,081.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-41.45
资产总计		25,191,052.46	54,018,664.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		72,552.88	112,156.61

应付管理人报酬		27,158.16	53,627.56
应付托管费		4,526.36	8,937.96
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.59	0.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	100,000.00	40,000.00
负债合计		204,237.99	214,722.44
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	34,178,212.14	51,035,702.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-9,191,397.67	2,768,239.67
净资产合计		24,986,814.47	53,803,941.67
负债和净资产总计		25,191,052.46	54,018,664.11

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7311 元，基金份额总额 34,178,212.14 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：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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 3 月 23 日(基 金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-14,185,266.15	16,178,968.33
1. 利息收入		13,587.96	73,250.55
其中：存款利息收入	7.4.7.13	12,294.40	43,105.77
债券利息收入		-	93.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,293.56	30,051.51
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,352,060.27	14,478,010.37

其中：股票投资收益	7.4.7.14	-12,792,402.17	14,045,452.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	197.98	13,420.89
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
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	440,143.92	419,136.90
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	-2,071,168.88	539,286.56
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	224,375.04	1,088,420.85
<b>减：二、营业总支出</b>		681,252.44	2,784,145.82
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	455,358.17	971,854.69
2. 托管费	7.4.10.2.2	75,893.03	161,975.81
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.24	0.07
8. 其他费用	7.4.7.23	150,001.00	1,650,315.25
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-14,866,518.59	13,394,822.51
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-14,866,518.59	13,394,822.51
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-14,866,518.59	13,394,822.51

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”金额合并列示在本年度报告利润表中“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：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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）	51,035,702.00	-	2,768,239.67	53,803,941.67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	51,035,702.00	-	2,768,239.67	53,803,941.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,857,489.86	-	-11,959,637.34	-28,817,127.20
（一）、综合收益总额	-	-	-14,866,518.59	-14,866,518.59
（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）	-16,857,489.86	-	2,906,881.25	-13,950,608.61
其中：1.基金申购款	27,070,780.06	-	-2,722,661.86	24,348,118.20
2.基金赎回款	-43,928,269.92	-	5,629,543.11	-38,298,726.81
（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）	34,178,212.14	-	-9,191,397.67	24,986,814.47
项目	上年度可比期间 2021 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2021 年 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）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	217,088,436.50	-	-	217,088,436.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-166,052,734.50	-	2,768,239.67	-163,284,494.83
（一）、综合收益总额	-	-	13,394,822.51	13,394,822.51
（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）	-166,052,734.50	-	-10,626,582.84	-176,679,317.34
其中：1.基金申购款	42,964,581.57	-	4,022,127.35	46,986,708.92
2.基金赎回款	-209,017,316.07	-	-14,648,710.19	-223,666,026.26
（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）	51,035,702.00	-	2,768,239.67	53,803,941.67

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
边燕萍

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
刘云鹏

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可(2020)2718号《关于准予渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金注册的批复》核准,由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 216,989,409.82 元,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(2021)第 0307 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 217,088,436.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 99,026.68 份基金份额。本基金的基金管理人为渤海汇金证券资产管理有限公司,基金托管人为中泰证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、政府机构债券、地方政府债券、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的 60-95%,其中投资于本基金界定的“新动能”主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为:中国战略新兴产业成份指数收益率\*70%+中债综合全价指数收益率 \*30%。

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及相关规定(以下简称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,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、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)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。上年度可比期间为2021年3月23日(基金生效日)至2021年12月31日止期间。

### 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。

本基金在上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、买入返售金融资产和应收利息,金额分别为人民币 4,017,224.88 元、人民币 2,000,000.00 元和人民币-84.01 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、买入返售金融资产和其他资产-应收利息。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,并反映在结算备付金和买入返售金融资产款项目中,不单独列示应收利息项目。新金融工具准则下,银行存款、买入返售金融资产和其他资产-应收利息的金额分别为人民币 4,017,812.37 元、人民币 1,999,328.50 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 47,838,399.30 元,归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 42.56 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 47,838,441.86 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,以基金管理人作为增值税纳税人,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	0.03	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	0.03	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-

减：坏账准备		-
其中：存款期限 1 个月以内		-
存款期限 1-3 个月		-
存款期限 3 个月以上		-
其他存款	2,063,589.96	4,017,224.88
等于：本金	2,063,382.59	4,017,224.88
加：应计利息	207.37	-
减：坏账准备		-
合计：	2,063,589.99	4,017,224.88

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。

#### 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	24,568,253.02	-	23,024,928.00	-1,543,325.02	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	88,788.20	83.73	100,314.63	11,442.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	88,788.20	83.73	100,314.63	11,442.70
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	24,657,041.22	83.73	23,125,242.63	-1,531,882.32	
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	47,279,324.54	-	47,809,528.70	530,204.16	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	19,788.20	-	28,870.60	9,082.40
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	19,788.20	-	28,870.60	9,082.40
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	47,299,112.74	-	47,838,399.30	539,286.56	

**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	-	-
合计	-	-
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	2,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,000.00	-

**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	-	-41.45
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-41.45

#### 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	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
-	-	-
应付利息	-	-
预提费用	100,000.00	40,000.00
合计	100,000.00	40,000.00

#### 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	51,035,702.00	51,035,702.00
本期申购	27,070,780.06	27,070,780.06
本期赎回（以“-”号填列）	-43,928,269.92	-43,928,269.92
- 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	34,178,212.14	34,178,212.14

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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	8,271,290.84	-5,503,051.17	2,768,239.67
本期利润	-12,795,349.71	-2,071,168.88	-14,866,518.59
本期基金份额交易产生的变动数	858,057.33	2,048,823.92	2,906,881.25
其中：基金申购款	697,004.95	-3,419,666.81	-2,722,661.86
基金赎回款	161,052.38	5,468,490.73	5,629,543.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,666,001.54	-5,525,396.13	-9,191,397.67

#### 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 3 月 23 日（基金合同生效日） 至 2021 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	0.43
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	12,293.97	41,295.25
结算备付金利息收入	-	-

其他	-	-
合计	12,294.40	43,105.77

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。

#### 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

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3月23日(基金合同生 效日)至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,792,402.17	14,045,452.58
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-12,792,402.17	14,045,452.58

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年3月23日(基金 合同生效日)至2021年12月 31日
卖出股票成交总额	327,153,104.45	601,764,084.85
减：卖出股票成本总额	339,099,940.23	587,718,632.27
减：交易费用	845,566.39	-
买卖股票差价收入	-12,792,402.17	14,045,452.58

##### 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3月23日(基金合 同生效日)至2021年12月31
----	---------------------------------	---

		日
债券投资收益——利息收入	197.98	-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-	13,420.89
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	197.98	13,420.89

#### 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3月23日(基金合 同生效日)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	-	32,331.49
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	-	18,900.00
减：应计利息总额	-	10.60
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	13,420.89

#### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

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

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

##### 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-买卖贵金属差价收入。

#### 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-赎回差价收入。

#### 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-申购差价收入。

### 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-买卖权证差价收入。

#### 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-其他投资收益。

### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	440,143.92	419,136.90
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	440,143.92	419,136.90

### 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年12月31日	上年度可比期间 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-2,071,168.88	539,286.56
——股票投资	-2,073,529.18	530,204.16
——债券投资	2,360.30	9,082.40
——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	-2,071,168.88	539,286.56

#### 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3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
基金赎回费收入	224,375.04	1,088,420.85
合计	224,375.04	1,088,420.85

#### 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3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
审计费用	20,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	1.00	-
其他费用	50,000.00	10,800.00
交易费用	-	1,599,515.25
合计	150,001.00	1,650,315.25

#### 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
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金托管人、基金销售机构、基金证券经纪商
渤海证券股份有限公司（“渤海证券”）	基金管理人的独资股东、基金销售机构、基金证券经纪商

注：1、本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

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3月23日(基金合同生效日)至2021年 12月31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	640,161,594.38	99.48%	1,034,075,897.11	83.85%
中泰证券	3,357,641.45	0.52%	199,167,295.99	16.15%

##### 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3月23日(基金合同生效日)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	-	-	33,260.29	94.71%
中泰证券	-	-	1,859.40	5.29%

##### 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3月23日(基金合同生效日)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	3,000,000.00	100.00%	158,900,000.00	56.59%
中泰证券	-	-	121,900,000.00	43.41%

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 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	463,566.95	99.48%	-	-
中泰证券	2,429.73	0.52%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年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	744,810.52	83.81%	-	-
中泰证券	143,844.30	16.19%	-	-

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3月23日(基金合同生效日) 至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	455,358.17
其中：支付销售机构的客户维护费	208,216.93	450,954.40

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。

#### 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3月23日(基金合同生效日) 至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	75,893.03	161,975.81

注：支付基金托管人中泰证券的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
基金合同生效日 ( 2021 年 3 月 23 日 ) 持有的基金份额	-	5,001,291.67
报告期初持有的基金份额	1,301,291.67	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	300,000.00	3,700,000.00
报告期末持有的基金份额	1,001,291.67	1,301,291.67
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.93%	2.55%

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 3 月 23 日(基金合同生效日)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
中泰证券-活期存款	0.03	0.43	-	1,810.52
中泰证券-其他存款	1,291,640.25	3,600.80	334,814.60	4,949.68
渤海证券-其他存款	771,949.71	8,693.17	3,682,410.28	36,345.57

注: 1、本基金的活期银行存款由基金托管人中泰证券保管, 按银行同业利率计息。

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

#### 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

注: 本基金本报告期内未进行利润分配。

## 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

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人建立了以董事会为风险管理的最高决策机构，以经营层负责风险管理主体责任，以首席风险官负责风险管理工作具体推动落实，以风险管理委员会为风险管理工作指导机构，由专职的风险控制部门为风险管理的督导执行部门，由管理、支持与保障部门及业务部门、各分支机构为风险管理的具体落实部门，由稽核部门为风险管理的督导审计部门的多层级的全面风险管理体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理制度，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	6,858.49	-
AAA 以下	90,435.06	25,866.70



未评级	3,021.08	3,003.90
合计	100,314.63	28,870.60

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

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担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。

#### 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款等利率敏感性资产，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	2,063,382.59	-	-	-	207.40	2,063,589.99
结算备付金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-18,765.30	81,465.60	23,025,011.73	23,125,242.63	23,125,242.63
应收申购款	-	-	-	-	2,219.84	2,219.84
资产总计	2,063,382.59	-18,765.30	81,465.60	23,027,438.97	25,191,052.46	25,191,052.46
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	72,552.88	72,552.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	27,158.16	27,158.16
应付托管费	-	-	-	-	4,526.36	4,526.36
应交税费	-	-	-	-	0.59	0.59
其他负债	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	-	204,237.99	204,237.99
利率敏感度缺口	2,063,382.59	-18,765.30	81,465.60	22,823,200.98	24,986,814.47	24,986,814.47
上年度末 2021 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	4,017,224.88	-	-	-	-	4,017,224.88
交易性金融资产	-	-	-28,870.60	47,809,528.70	47,838,399.30	47,838,399.30
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	-	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-41.45	-41.45
应收申购款	-	-	-	-	163,081.38	163,081.38
-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,017,224.88	-	-28,870.60	47,972,568.63	54,018,664.11	54,018,664.11
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	112,156.61	112,156.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	53,627.56	53,627.56
应付托管费	-	-	-	-	8,937.96	8,937.96
应交税费	-	-	-	-	0.31	0.31

其他负债	-	-	-	40,000.00	40,000.00
负债总计	-	-	-	214,722.44	214,722.44
利率敏感度缺口	6,017,224.88	-	-28,870.60	47,757,846.19	53,803,941.67

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	-117.53	4,878.47
	2. 市场利率下降 25 个基点	123.81	-4,871.74

#### 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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	23,024,928.00	92.15	47,809,528.70	88.86
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	100,314.63	0.40	28,870.60	0.05
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	23,125,242.63	92.55	47,838,399.30	88.91

## 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	674,400.61	1,657,322.11
2. 业绩比较基准下降 5%	-674,400.61	-1,657,322.11	

## 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：无。

## 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	23,024,928.00	45,306,126.66
第二层次	100,314.63	28,870.60
第三层次	-	2,503,402.04
合计	23,125,242.63	47,838,399.30

##### 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

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			合计
	交易性金融资产			
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	2,503,402.04	-	2,503,402.04
当期购买	-	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	2,503,402.04	-	2,503,402.04
当期利得或损失总额	-	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产	-	-	-	-

项目	上年度可比期间 2021 年 3 月 23 日 (基金合同生效 日)至 2021 年 12 月 31 日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	基金投资	
计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益				
期初余额	-	-	-	-
当期购买	-	2,503,402.04	-	2,503,402.04
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-
期末余额	-	2,503,402.04	-	2,503,402.04
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-	-

#### 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	23,024,928.00	91.40
	其中：股票	23,024,928.00	91.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,314.63	0.40
	其中：债券	100,314.63	0.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,063,589.99	8.19
8	其他各项资产	2,219.84	0.01
9	合计	25,191,052.46	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,279,537.00	77.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	324,536.00	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,705,335.00	10.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	377,280.00	1.51
N	水利、环境和公共设施管理业	338,240.00	1.35



0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,024,928.00	92.15

### 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

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	002262	恩华药业	17,000	417,350.00	1.67
2	002410	广联达	6,900	413,655.00	1.66
3	000597	东北制药	64,700	408,257.00	1.63
4	688385	复旦微电	5,800	404,898.00	1.62
5	300661	圣邦股份	2,300	396,980.00	1.59
6	300347	泰格医药	3,600	377,280.00	1.51
7	600570	恒生电子	9,000	364,140.00	1.46
8	002531	天顺风能	24,000	363,120.00	1.45
9	688516	奥特维	1,800	361,800.00	1.45
10	002802	洪汇新材	24,700	357,162.00	1.43
11	688668	鼎通科技	5,400	356,400.00	1.43
12	000921	海信家电	26,600	350,322.00	1.40
13	000878	云南铜业	29,400	345,450.00	1.38
14	002017	东信和平	26,100	343,215.00	1.37
15	300698	万马科技	14,400	340,992.00	1.36
16	688229	博睿数据	10,000	340,500.00	1.36
17	688177	百奥泰	15,600	339,768.00	1.36
18	603321	梅轮电梯	49,500	339,570.00	1.36
19	688215	瑞晟智能	11,000	338,250.00	1.35
20	688466	金科环境	22,400	338,240.00	1.35
21	300535	达威股份	26,300	337,955.00	1.35
22	603159	上海亚虹	25,800	336,432.00	1.35
23	600843	上工申贝	67,500	334,800.00	1.34
24	300126	锐奇股份	59,900	334,242.00	1.34
25	000691	亚太实业	73,600	334,144.00	1.34

26	600761	安徽合力	25,400	334,010.00	1.34
27	600768	宁波富邦	36,300	333,597.00	1.34
28	300311	任子行	54,800	333,184.00	1.33
29	603083	剑桥科技	29,600	332,704.00	1.33
30	688367	工大高科	21,000	332,220.00	1.33
31	688004	博汇科技	16,000	331,520.00	1.33
32	000533	顺钠股份	87,500	330,750.00	1.32
33	688096	京源环保	27,400	330,718.00	1.32
34	688038	中科通达	27,800	330,542.00	1.32
35	002560	通达股份	48,300	329,406.00	1.32
36	300717	华信新材	23,500	329,000.00	1.32
37	603269	海鸥股份	26,600	328,510.00	1.31
38	002885	京泉华	11,000	328,020.00	1.31
39	600850	电科数字	16,300	327,304.00	1.31
40	300684	中石科技	22,100	327,301.00	1.31
41	300711	广哈通信	29,200	326,456.00	1.31
42	300644	南京聚隆	23,600	325,916.00	1.30
43	300445	康斯特	26,700	325,740.00	1.30
44	300321	同大股份	22,100	324,870.00	1.30
45	600538	国发股份	71,800	324,536.00	1.30
46	000700	模塑科技	69,900	324,336.00	1.30
47	603861	白云电器	43,400	324,198.00	1.30
48	300417	南华仪器	33,400	323,980.00	1.30
49	300210	森远股份	110,700	323,244.00	1.29
50	300807	天迈科技	15,800	322,952.00	1.29
51	300931	通用电梯	48,900	322,251.00	1.29
52	300258	精锻科技	27,700	322,151.00	1.29
53	301007	德迈仕	29,600	322,048.00	1.29
54	603725	天安新材	46,600	322,006.00	1.29
55	300069	金利华电	25,600	320,768.00	1.28
56	300163	先锋新材	103,600	320,124.00	1.28
57	300100	双林股份	43,500	318,855.00	1.28
58	600686	金龙汽车	53,500	318,325.00	1.27
59	300637	扬帆新材	49,400	318,136.00	1.27
60	300567	精测电子	6,300	316,260.00	1.27
61	600469	风神股份	67,200	315,168.00	1.26
62	688111	金山办公	1,000	264,490.00	1.06
63	300129	泰胜风能	35,300	253,101.00	1.01
64	603037	凯众股份	15,200	244,416.00	0.98

65	600421	华嵘控股	22,000	237,380.00	0.95
66	688681	科汇股份	18,400	234,784.00	0.94
67	300521	爱司凯	23,200	230,144.00	0.92
68	300689	澄天伟业	13,900	226,431.00	0.91
69	300478	杭州高新	24,400	224,968.00	0.90
70	300097	智云股份	41,800	220,286.00	0.88
71	600438	通威股份	5,000	192,900.00	0.77

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002812	恩捷股份	3,335,708.00	6.20
2	300347	泰格医药	2,491,918.00	4.63
3	688668	鼎通科技	2,383,861.49	4.43
4	300014	亿纬锂能	2,372,340.00	4.41
5	600900	长江电力	2,323,059.00	4.32
6	600141	兴发集团	2,177,171.00	4.05
7	600096	云天化	2,067,731.70	3.84
8	600438	通威股份	2,026,444.00	3.77
9	300829	金丹科技	2,010,503.72	3.74
10	002460	赣锋锂业	2,007,340.00	3.73
11	002821	凯莱英	1,944,524.00	3.61
12	688385	复旦微电	1,926,692.09	3.58
13	300750	宁德时代	1,922,682.00	3.57
14	600763	通策医疗	1,907,882.09	3.55
15	003038	鑫铂股份	1,837,401.00	3.41
16	300316	晶盛机电	1,805,527.00	3.36
17	000803	山高环能	1,793,025.00	3.33
18	000661	长春高新	1,758,670.00	3.27
19	603659	璞泰来	1,756,947.00	3.27
20	002258	利尔化学	1,683,104.00	3.13
21	603259	药明康德	1,675,903.00	3.11
22	000733	振华科技	1,659,529.00	3.08
23	002895	川恒股份	1,582,476.74	2.94

24	300037	新宙邦	1,577,188.40	2.93
25	300759	康龙化成	1,552,655.00	2.89
26	300593	新雷能	1,541,946.00	2.87
27	600888	新疆众和	1,538,619.00	2.86
28	688516	奥特维	1,509,002.63	2.80
29	300390	天华超净	1,485,378.00	2.76
30	603290	斯达半导	1,482,916.00	2.76
31	001216	华瓷股份	1,414,988.00	2.63
32	600276	恒瑞医药	1,411,206.00	2.62
33	600025	华能水电	1,354,893.70	2.52
34	688033	天宜上佳	1,334,826.45	2.48
35	600436	片仔癀	1,323,184.81	2.46
36	003019	宸展光电	1,315,601.00	2.45
37	300363	博腾股份	1,310,548.00	2.44
38	603185	上机数控	1,308,428.00	2.43
39	688148	芳源股份	1,290,642.65	2.40
40	002648	卫星化学	1,281,477.00	2.38
41	603328	依顿电子	1,267,334.00	2.36
42	300274	阳光电源	1,251,124.00	2.33
43	002801	微光股份	1,210,669.00	2.25
44	002709	天赐材料	1,210,425.00	2.25
45	600760	中航沈飞	1,209,005.00	2.25
46	688202	美迪西	1,196,086.16	2.22
47	300760	迈瑞医疗	1,178,983.00	2.19
48	603392	万泰生物	1,167,542.00	2.17
49	002007	华兰生物	1,166,094.10	2.17
50	300570	太辰光	1,159,345.00	2.15
51	000408	藏格矿业	1,153,291.00	2.14
52	300782	卓胜微	1,147,810.00	2.13
53	603127	昭衍新药	1,147,724.00	2.13
54	300763	锦浪科技	1,143,142.00	2.12
55	002920	德赛西威	1,143,117.00	2.12
56	603339	四方科技	1,134,977.00	2.11
57	688111	金山办公	1,128,762.56	2.10
58	300160	秀强股份	1,123,886.00	2.09
59	688196	卓越新能	1,113,683.46	2.07

60	300926	博俊科技	1,113,098.00	2.07
61	300015	爱尔眼科	1,108,483.00	2.06
62	603588	高能环境	1,105,957.00	2.06
63	300601	康泰生物	1,102,778.80	2.05
64	601012	隆基绿能	1,098,952.00	2.04
65	603906	龙蟠科技	1,097,296.00	2.04
66	601668	中国建筑	1,085,298.00	2.02
67	600562	国睿科技	1,078,068.00	2.00

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。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002812	恩捷股份	3,939,089.00	7.32
2	600900	长江电力	2,785,779.00	5.18
3	603290	斯达半导	2,705,964.00	5.03
4	300014	亿纬锂能	2,653,507.00	4.93
5	600941	中国移动	2,569,668.14	4.78
6	002821	凯莱英	2,310,535.20	4.29
7	688668	鼎通科技	2,274,942.02	4.23
8	300347	泰格医药	2,239,937.00	4.16
9	300750	宁德时代	2,217,760.00	4.12
10	600763	通策医疗	2,217,336.00	4.12
11	603259	药明康德	2,074,228.80	3.86
12	000661	长春高新	2,061,757.00	3.83
13	300829	金丹科技	2,059,398.00	3.83
14	002460	赣锋锂业	2,005,700.80	3.73
15	002594	比亚迪	1,999,901.00	3.72
16	600141	兴发集团	1,969,480.00	3.66
17	003038	鑫铂股份	1,952,885.60	3.63
18	600438	通威股份	1,939,139.00	3.60
19	300759	康龙化成	1,849,146.00	3.44
20	603185	上机数控	1,848,410.00	3.44
21	300316	晶盛机电	1,840,738.00	3.42
22	300390	天华超净	1,839,269.00	3.42
23	600096	云天化	1,809,009.00	3.36

24	000803	山高环能	1,757,125.00	3.27
25	300593	新雷能	1,727,181.20	3.21
26	600436	片仔癀	1,726,594.00	3.21
27	603659	璞泰来	1,708,423.00	3.18
28	002258	利尔化学	1,660,791.00	3.09
29	688033	天宜上佳	1,612,802.72	3.00
30	300037	新宙邦	1,606,391.60	2.99
31	300124	汇川技术	1,599,484.00	2.97
32	002709	天赐材料	1,587,575.00	2.95
33	300763	锦浪科技	1,587,405.50	2.95
34	000733	振华科技	1,533,577.00	2.85
35	300015	爱尔眼科	1,532,949.64	2.85
36	600888	新疆众和	1,531,420.00	2.85
37	601012	隆基绿能	1,519,391.20	2.82
38	688516	奥特维	1,518,975.91	2.82
39	300274	阳光电源	1,500,685.00	2.79
40	688385	复旦微电	1,495,027.71	2.78
41	603392	万泰生物	1,451,781.85	2.70
42	300760	迈瑞医疗	1,435,399.70	2.67
43	002371	北方华创	1,425,910.00	2.65
44	002895	川恒股份	1,423,698.00	2.65
45	300782	卓胜微	1,387,948.01	2.58
46	600276	恒瑞医药	1,365,358.40	2.54
47	002920	德赛西威	1,359,344.00	2.53
48	603127	昭衍新药	1,331,389.80	2.47
49	600025	华能水电	1,311,230.00	2.44
50	300363	博腾股份	1,309,591.00	2.43
51	002459	晶澳科技	1,303,657.00	2.42
52	001216	华瓷股份	1,292,082.00	2.40
53	603328	依顿电子	1,280,318.00	2.38
54	688202	美迪西	1,276,186.60	2.37
55	688148	芳源股份	1,269,946.46	2.36
56	002648	卫星化学	1,263,280.36	2.35
57	600760	中航沈飞	1,258,877.00	2.34
58	000519	中兵红箭	1,257,274.00	2.34
59	003019	宸展光电	1,242,239.00	2.31
60	300601	康泰生物	1,231,158.80	2.29
61	300160	秀强股份	1,227,111.00	2.28

62	002801	微光股份	1,218,404.00	2.26
63	603501	韦尔股份	1,202,885.00	2.24
64	300926	博俊科技	1,201,286.00	2.23
65	601633	长城汽车	1,135,445.00	2.11
66	688196	卓越新能	1,129,938.60	2.10
67	600389	江山股份	1,121,465.00	2.08
68	002007	华兰生物	1,112,359.00	2.07
69	601668	中国建筑	1,108,417.00	2.06
70	300570	太辰光	1,107,314.00	2.06
71	300059	东方财富	1,094,479.80	2.03
72	603906	龙蟠科技	1,078,823.00	2.01

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。

#### 8.4.3 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	316,388,868.71
卖出股票收入（成交）总额	327,153,104.45

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。

#### 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	3,021.08	0.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	97,293.55	0.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,314.63	0.40

#### 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	110089	兴发转债	630	71,658.89	0.29
2	123127	耐普转债	100	11,270.42	0.05
3	113633	科沃转债	70	7,505.75	0.03
4	113053	隆 22 转债	60	6,858.49	0.03
5	019547	16 国债 19	30	3,021.08	0.01

### 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

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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

#### 8.12.2 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

#### 8.12.3 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	2,219.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,219.84

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123127	耐普转债	11,270.42	0.05
2	113633	科沃转债	7,505.75	0.03
3	113053	隆 22 转债	6,858.49	0.03

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## § 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
924	36,989.41	1,092,220.23	3.20%	33,085,991.91	96.80%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,158,608.37	6.32%

### 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：不涉及，期末无兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年3月23日）基金份额总额	217,088,436.50
本报告期期初基金份额总额	51,035,702.00
本报告期基金总申购份额	27,070,780.06
减:本报告期基金总赎回份额	43,928,269.92
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	34,178,212.14

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2022 年 7 月 27 日表决通过了《关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金修改基金合同终止条款有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。具体有关事项详见基金管理人于 2022 年 7 月 29 日披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》及 2022 年 7 月 29 日披露的《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》等法律文件。

### 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 20,000.00 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	640,161,594.38	99.48%	463,566.95	99.48%	-
中泰证券	2	3,357,641.45	0.52%	2,429.73	0.52%	-

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

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	2021年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（副总经理）变更公告	公司网站、中国证券报	2022年1月1日
2	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	公司网站	2022年1月1日
3	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报	2022年1月4日
4	关于渤海汇金证券资产管理有限公司董事会成员变更的公告	公司网站	2022年1月11日
5	关于渤海汇金证券资产管理有限公司董事会成员变更的公告	中国证券报	2022年1月12日
6	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021年第2号）	公司网站	2022年1月21日
7	渤海汇金新动能主题混合型证券	公司网站	2022年1月21日

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

17	关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	公司网站、中国证券报	2022 年 3 月 31 日
18	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站	2022 年 4 月 22 日
19	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证券报	2022 年 4 月 22 日
20	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加北京创金启富基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 12 日
21	关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 26 日
22	渤海汇金证券资产管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 30 日
23	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 31 日
24	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加中正达广基金销售有限公司为代销机构并	公司网站、中国证券报	2022 年 5 月 31 日



	参与基金费率优惠活动的公告		
25	渤海汇金证券资产管理有限公司 关于旗下部分基金增加洪泰财富 (青岛)基金销售有限责任公司 为代销机构并参与基金费率优惠 活动的公告	公司网站、中国证券报	2022年6月2日
26	关于渤海汇金新动能主题混合型 证券投资基金基金资产净值连续 低于5000万元的提示性公告	公司网站、中国证券报	2022年6月10日
27	渤海汇金证券资产管理有限公司 关于以通讯方式召开渤海汇金新 动能主题混合型证券投资基金基 金份额持有人大会的公告	公司网站、中国证券报	2022年6月15日
28	渤海汇金证券资产管理有限公司 关于以通讯方式召开渤海汇金新 动能主题混合型证券投资基金基 金份额持有人大会的第一次提示 性公告	公司网站、中国证券报	2022年6月16日
29	渤海汇金证券资产管理有限公司 关于以通讯方式召开渤海汇金新 动能主题混合型证券投资基金基 金份额持有人大会的第二次提示 性公告	公司网站、中国证券报	2022年6月17日
30	关于渤海汇金新动能主题混合型 证券投资基金基金资产净值连续 低于5000万元的提示性公告	公司网站、中国证券报	2022年6月17日
31	渤海汇金证券资产管理有限公司 关于旗下部分基金更新代销机构 洪泰财富(青岛)基金销售有限	公司网站、中国证券报	2022年6月28日

	责任公司相关信息的公告		
32	渤海汇金证券资产管理有限公司 关于旗下部分基金增加上海挖财 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 7 月 1 日
33	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
34	渤海汇金新动能主题混合型证券 投资基金 2022 年第 2 季度报告	公司网站	2022 年 7 月 21 日
35	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
36	渤海汇金证券资产管理有限公司 关于渤海汇金新动能主题混合型 证券投资基金份额持有人大会表 决结果暨决议生效的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 7 月 29 日
37	渤海汇金新动能主题混合型证券 投资基金基金合同（2022 年 7 月 修订）	公司网站	2022 年 7 月 29 日
38	渤海汇金新动能主题混合型证券 投资基金招募说明书（更新） （2022 年第 1 号）	公司网站	2022 年 7 月 29 日
39	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国人寿 保险股份有限公司为代销机构并 参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 8 月 1 日
40	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 8 月 11 日

	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		
41	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2022 年中期报告	公司网站	2022 年 8 月 31 日
42	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
43	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加九州证券股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报	2022 年 9 月 9 日
44	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海东证期货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 10 月 18 日
45	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
46	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
47	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	公司网站	2022 年 10 月 26 日
48	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
49	渤海汇金证券资产管理有限公司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	公司网站、中国证券报	2022 年 11 月 9 日

	参与基金费率优惠活动的公告		
50	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站	2022年11月11日
51	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2022年第2号）	公司网站	2022年11月11日
52	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下2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11月11日
53	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
54	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

注：无。

### 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新动能主题混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金在指定报刊上的各项公告。

### 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