

# 渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人:江苏银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经董事会审议，并由董事长签发。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月24日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	40
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40

7.12 投资组合报告附注.....	40
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	42
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金	
基金简称	渤海汇金汇享益利率债	
基金主代码	018676	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 01 月 24 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	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,701,937,617.07 份	
基金合同存续期	-	
下属分级基金的基金简称	渤海汇金汇享益利率债 A	渤海汇金汇享益利率债 C
下属分级基金的交易代码	018676	018677
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,701,928,036.72 份	9,580.35 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、久期调整策略</p> <p>债券投资受利率风险的影响。本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期值，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升收益；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以规避债券价格下降的风险带来的资本损失，获得较高的再投资收益。</p> <p>2、收益率曲线配置策略</p> <p>本基金将综合考察收益率曲线，通过预期收益率曲线形态变化走势来调整投资组合的头寸。</p> <p>在考察收益率曲线的基础上，本基金将确定采用集中策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变和不同期限债券的相对价格变化中获利。一般而言，当预期收益率曲线变陡时，本基金将采用集中策略；当预期收益率曲线变平时，将采用哑铃策略；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采用梯形策略。</p> <p>3、骑乘策略</p> <p>通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，当债券收益率</p>

	<p>曲线比较陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，这样可同时获得该债券持有期的稳定的票息收入以及收益率下降带来的价差收入；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际</p> <p>4、息差策略</p> <p>当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购并将所融入的资金投资于债券，从而获取债券收益率超出回购资金成本（即回购利率）的套利价值。</p> <p>5、国债期货交易策略</p> <p>本基金将认真研究国债期货市场运行特征，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，使用该类交易工具，提高组合收益。</p>
业绩比较基准	中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率*90%+同期活期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 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	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴国威	田作全
	联系电话	022-23861655	025-58588321
	电子邮箱	liujia@bhhjamc.com	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话		400-651-1717	95319
传真		022-23861651	025-58588155
注册地址		深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号基金小镇对冲基金中心 506	南京市中华路 26 号
办公地址		深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号基金小镇对冲基金中心 506	南京市中华路 26 号
邮政编码		518054	210001
法定代表人		齐朝晖	葛仁余

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.bhhjamc.com">https://www.bhhjamc.com</a>

基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所
------------	---------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	渤海汇金证券资产管理有限公司	天津市南开区宾水西道 8 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）-2024 年 06 月 30 日）	
	渤海汇金汇享益利率债 A	渤海汇金汇享益利率债 C
本期已实现收益	18,099,322.52	50.14
本期利润	31,955,553.80	77.72
加权平均基金份额本期利润	0.0222	0.0179
本期加权平均净值利润率	2.20%	1.77%
本期基金份额净值增长率	2.27%	2.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	21,757,946.42	112.13
期末可供分配基金份额利润	0.0128	0.0117
期末基金资产净值	1,740,599,437.30	9,787.97
期末基金份额净值	1.0227	1.0217
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	2.27%	2.17%

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。

4、本基金合同于 2024 年 1 月 24 日生效，截至本报告期末成立未满 1 年，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

## 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

#### 渤海汇金汇享益利率债 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	----------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	0.64%	0.04%	0.60%	0.05%	0.04%	-0.01%
过去三个月	1.46%	0.06%	0.95%	0.08%	0.51%	-0.02%
自基金合同生 效起至今	2.27%	0.06%	1.87%	0.09%	0.40%	-0.03%

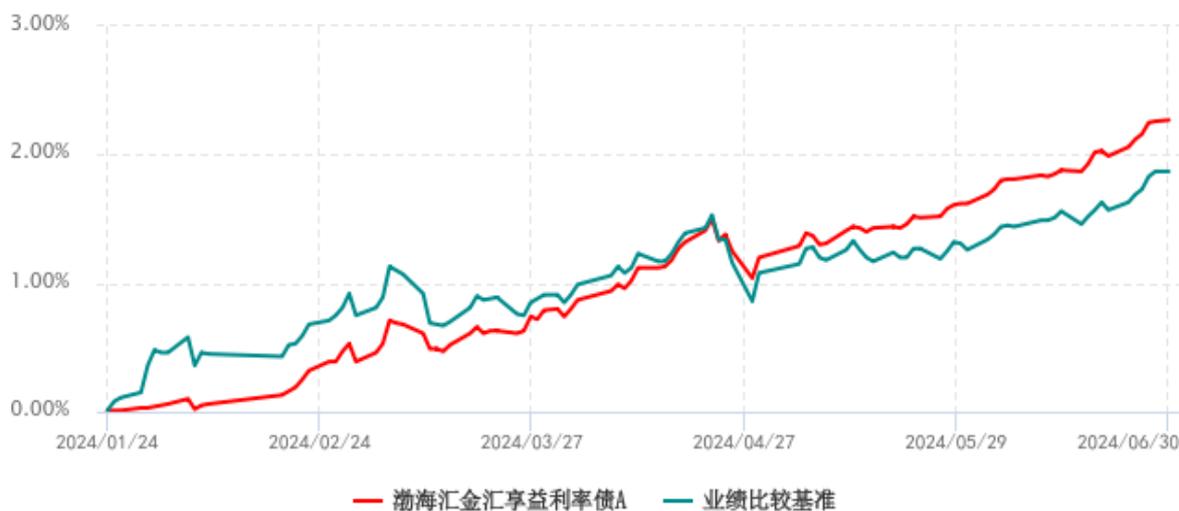
## 渤海汇金汇享益利率债 C 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.62%	0.04%	0.60%	0.05%	0.02%	-0.01%
过去三个月	1.41%	0.06%	0.95%	0.08%	0.46%	-0.02%
自基金合同生 效起至今	2.17%	0.06%	1.87%	0.09%	0.30%	-0.03%

注：业绩比较基准：中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率\*90%+同期活期存款利率（税后）\*10%

### 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

渤海汇金汇享益利率债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年01月24日-2024年06月30日)



渤海汇金汇享益利率债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年01月24日-2024年06月30日)



注：1、本基金合同于 2024 年 1 月 24 日生效。

2、自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚处于建仓期。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

渤海汇金证券资产管理有限公司（简称渤海汇金、渤海汇金资管）前身为渤海证券资产管理总部，经中国证监会证监许可[2016]3 号文批准，成立于 2016 年 5 月 18 日。注册地为深圳，注册资本为 11 亿元，业务范围为证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务，是渤海证券股份有限公司的全资子公司。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 17 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、渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金

(FOF)、渤海汇金优选进取 6 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、渤海汇金优选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金、渤海汇金 2 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高延龙	本基金基金经理	2024-01-24	-	4 年	墨尔本大学金融学硕士，特许金融分析师(CFA)，2013 年 3 月至 2015 年 3 月就职于联合资信评估有限公司，任分析师。2015 年 3 月至 2016 年 1 月就职于国开城市交通投资发展基金，任投资经理。2016 年 2 月至 2020 年 3 月就职于渤海人寿保险股份有限公司，任债券投资经理。2020 年 3 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，2023 年 4 月任公募固收部信用投资团队基金经理。2020 年 6 月起任渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 1 月任汇添金货币市场基金基金经理。2020 年 11 月起担任渤海汇金汇裕 87 个月定开基金基金经理。2021 年 8 月起任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。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。2024 年 1 月起担任渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金基金经理。
李杨	本基金基金经理	2024-01-29	-	7 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

				<p>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 月至 2023 年 6 月担任渤海汇金汇添益 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 月至 2022 年 12 月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。2023 年 2 月起任渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 1 月起担任渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

注：无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合

法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律、法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对指令进行综合平衡，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，并通过恒生 O32 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。报告期内，本基金未发生异常交易行为，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较少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

上半年，债市整体大幅走强，收益率呈现先下后上再下局面，其中一季度，市场对经济复苏预期维持低位，货币政策宽松加码预期也随之加强，且在缺资产背景下，配置及交易力量交织影响债市，促使债券收益率持续创出历史新低，而 3 月受制于特别国债发行、汇率及经济企稳预期等因素，债市开始进入多空拉锯阶段。进入二季度，债市波动有所加大，利多驱动因素涵盖了流动性相对宽松、基本面低位震荡、手工贴息取消促使存款搬家、资产欠配、机构风险偏好回落等；利空扰动因素包括了监管对长端债券的风险提示、地产政策出台、特别国债发行等。估值上看，长债收益率于半年末收于低点，10 年和 30 年期国债收益率上半年分别累计回落 35bp 和 40bp；受益于流动性宽松，中短端表现同等强势，3、5 年期国开债分别累计回落 40bp 和 46bp，1 年期大行存单回落 45bp；收益率曲线大致呈现平行下移格局。

报告期内基金以利率债投资交易为主，组合久期整体中性偏上，杠杆使用率不高。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末渤海汇金汇享益利率债 A 基金份额净值为 1.0227 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.27%，同期业绩比较基准收益率为 1.87%；截至报告期末渤海汇金汇享益利率债 C 基金份额净值为 1.0217 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.17%，同期业绩比较基准收益率为 1.87%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，基本面仍在低位震荡，尤其地产疲弱继续拖累总需求反弹，且有效资产欠缺对债市仍有较大支撑，年内债市仍不悲观。7月下旬央行进行了一系列超预期降息操作，MLF补降至2.3%，故此长债下行空间得以有效打开。后续还需关注央行卖债落地情况及三季度供给压力，若收益率出现一定幅度反弹，则可积极参与配置及交易。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同（第十六部分基金的收益与分配中三、基金收益分配原则）的约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何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，本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现渤海汇金证券资产管理有限公司

在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

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

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	2,856,102.69
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,593,271,249.68
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,593,271,249.68
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	145,035,136.99
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		2,000.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		1,741,164,489.36
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-

衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		338,048.62
应付托管费		112,682.88
应付销售服务费		1.78
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	104,530.81
负债合计		555,264.09
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	1,701,937,617.07
未分配利润	6.4.7.8	38,671,608.20
净资产合计		1,740,609,225.27
负债和净资产总计		1,741,164,489.36

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,701,937,617.07 份。其中渤海汇金汇享益利率债 A 基金份额净值 1.0227 元，基金份额总额 1,701,928,036.72 份；渤海汇金汇享益利率债 C 基金份额净值 1.0217 元，基金份额总额 9,580.35 份。

## 6.2 利润表

会计主体：渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		35,045,735.15
1. 利息收入		2,223,233.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	715,732.63
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,507,501.31
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,890,687.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	18,890,687.35
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,856,258.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	75,555.00
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,090,103.63</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,873,911.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	624,637.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4.60
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		507,716.91
其中：卖出回购金融资产支出		507,716.91
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.20	83,833.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>31,955,631.52</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>31,955,631.52</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>31,955,631.52</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	2,180,001,444.00	-	2,180,001,444.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-478,063,826.93	38,671,608.20	-439,392,218.73
（一）、综合收益总额	-	31,955,631.52	31,955,631.52
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-478,063,826.93	6,715,976.68	-471,347,850.25
其中：1. 基金申购款	493,288,579.21	9,238,953.97	502,527,533.18
2. 基金赎回款	-971,352,406.14	-2,522,977.29	-973,875,383.43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净	-	-	-

资产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	1,701,937,617.07	38,671,608.20	1,740,609,225.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

吴国威	边燕萍	刘云鹏
—————	—————	—————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2023)1181号《关于准予渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金注册的批复》核准,由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,179,991,163.64元,已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(24)第00013号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金基金合同》于2024年1月24日正式生效,基金成立日的基金份额总额为2,180,001,444.00份基金份额,其中认购资金利息折合10,280.36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,基金托管人为江苏银行股份有限公司。

本基金主要投资于国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、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(AAA)、货币市场工具、国债期货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)。本基金不投资于股票、可转换债券和可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于利率债资产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合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金所指利率债是指国债、地方政府债、央行票据、政策性金融债。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可调整上述投资品种的投资比例。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“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关于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。

#### 6.4.3 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 24 日(基金成立日)至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日(基金成立日)至 2024 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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以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。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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净资产的比例，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)。

#### 6.4.4.9 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。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### (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。

##### (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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金在符合基金法定分红条件的前提下，可进行收益分配，每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

#### 6.4.4.13 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。

#### 6.4.4.14 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：

根据中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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]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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	2,856,102.69

等于：本金	2,855,701.89
加：应计利息	400.80
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	2,856,102.69

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 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	-	-	-
	银行间市场	1,558,281,741.14	21,133,249.68	1,593,271,249.68
	合计	1,558,281,741.14	21,133,249.68	1,593,271,249.68
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,558,281,741.14	21,133,249.68	1,593,271,249.68	13,856,258.86

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-

银行间市场	145,035,136.99	-
合计	145,035,136.99	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	25,696.93
其中：交易所市场	-
银行间市场	25,696.93
应付利息	-
预提费用	78,833.88
合计	104,530.81

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 渤海汇金汇享益利率债 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,179,998,399.46	2,179,998,399.46
本期申购	493,258,102.51	493,258,102.51
本期赎回（以“-”号填列）	-971,328,465.25	-971,328,465.25
本期末	1,701,928,036.72	1,701,928,036.72

##### 渤海汇金汇享益利率债 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,044.54	3,044.54
本期申购	30,476.70	30,476.70
本期赎回（以“-”号填列）	-23,940.89	-23,940.89

本期末	9,580.35	9,580.35
-----	----------	----------

## 6.4.7.8 未分配利润

## 渤海汇金汇享益利率债 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	18,099,322.52	13,856,231.28	31,955,553.80
本期基金份额交易产生的变动数	3,658,623.90	3,057,222.88	6,715,846.78
其中：基金申购款	5,461,767.75	3,776,652.92	9,238,420.67
基金赎回款	-1,803,143.85	-719,430.04	-2,522,573.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,757,946.42	16,913,454.16	38,671,400.58

## 渤海汇金汇享益利率债 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	50.14	27.58	77.72
本期基金份额交易产生的变动数	61.99	67.91	129.90
其中：基金申购款	305.87	227.43	533.30
基金赎回款	-243.88	-159.52	-403.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	112.13	95.49	207.62

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	703,918.31
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	11,814.32
其他	-
合计	715,732.63

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

注：本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	14,563,356.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,327,331.14
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	18,890,687.35

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,925,047,258.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,898,290,928.86
减：应计利息总额	22,394,098.96
减：交易费用	34,900.00
买卖债券差价收入	4,327,331.14

##### 6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

注：本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
------	--

1. 交易性金融资产	13,856,258.86
——股票投资	-
——债券投资	13,856,258.86
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	13,856,258.86

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	75,555.00
合计	75,555.00

#### 6.4.7.19 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	18,542.58
信息披露费	50,991.30
证券出借违约金	-
证券账户开户费	400.00
账户维护费	13,900.00
合计	83,833.88

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
渤海汇金证券资产管理有限公司 （“渤海汇金资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人
渤海证券股份有限公司（“渤海证券”）	基金管理人的独资股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
渤海证券	1,724,100,000.00	100.00%

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日） 至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,873,911.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	28,594.33
应支付基金管理人的净管理费	1,845,316.85

注：支付基金管理人渤海汇金资管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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.3\% / \text{当年天数}$ 。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	624,637.06

注：支付基金托管人江苏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： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}$ 。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给渤海汇金，再由渤海汇金计算并支付给各基金销售机构。本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，其计算公式为： $\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$ 。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

注：本基金本报告期内未与关联方发生重大转融通证券出借业务。

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

注：本基金本报告期内未与关联方发生重大转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

注：本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 24 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行	2,856,102.69	703,918.31

注：本基金的活期银行存款由基金托管人江苏银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易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。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

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。

**6.4.13.2.2 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 2024 年 06 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	1,593,271,249.68
合计	1,593,271,249.68

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。

**6.4.13.3 流动性风险**

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

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

**6.4.13.3.1 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。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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 4年 06 月 30 日	6个月以内	6个月 - 1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资 产						
货 币	2,856,102.69	-	-	-	-	2,856,102.69

资金						
交易性金融资产	91,951,155.74	-	922,670,106.32	578,649,987.62	-	1,593,271,249.68
买入返售金融资产	145,035,136.99	-	-	-	-	145,035,136.99
应收申购款	-	-	-	-	2,000.00	2,000.00
资产总计	239,842,395.42	-	922,670,106.32	578,649,987.62	2,000.00	1,741,164,489.36
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	338,048.62	338,048.62
应付托管费	-	-	-	-	112,682.88	112,682.88
应付销售	-	-	-	-	1.78	1.78

服务费						
其他负债	-	-	-	-	104,530.81	104,530.81
负债总计	-	-	-	-	555,264.09	555,264.09
利率敏感度缺口	239,842,395.42	-	922,670,106.32	578,649,987.62	-553,264.09	1,740,609,225.27

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2024 年 06 月 30 日
	1. 市场利率上升 25 个基点	-15,672,345.62
	2. 市场利率下降 25 个基点	15,623,451.13

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
----	----------------------

	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,593,271,249.68	91.54
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	1,593,271,249.68	91.54

#### 6.4.13.4.4 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。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日
第一层次	-
第二层次	1,593,271,249.68
第三层次	-
合计	1,593,271,249.68

###### 6.4.14.2.2 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。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金及买入返售金融资产款等，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,593,271,249.68	91.51
	其中：债券	1,593,271,249.68	91.51
	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	145,035,136.99	8.33
	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	2,856,102.69	0.16
8	其他各项资产	2,000.00	0.00
9	合计	1,741,164,489.36	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未持有股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未持有股票。

### 7.4.3 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。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	359,498,277.51	20.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,233,772,972.17	70.88
	其中：政策性金融债	1,233,772,972.17	70.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,593,271,249.68	91.54

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	092218002	22 农发清发 02	1,000,000	104,671,557.38	6.01
2	230313	23 进出 13	1,000,000	103,129,617.49	5.92
3	230303	23 进出 03	1,000,000	101,924,164.38	5.86
4	220019	22 付息国债 19	900,000	93,439,760.87	5.37
5	230407	23 农发 07	900,000	92,180,638.36	5.30

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

不适用

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

不适用

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

不适用

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本报告期内未发现本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内不存在所投资的前十名股票超出基金合同规定之备选股票库的情况。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,000.00
---	----	----------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
渤海汇金汇享益利率债 A	56	30,391,572.08	1,701,428,522.76	99.97%	499,513.96	0.03%
渤海汇金汇享益利率债 C	246	38.94	-	-	9,580.35	100.00%
合计	298	5,711,200.06	1,701,428,522.76	99.97%	509,094.31	0.03%

注：期末有 4 名基金份额持有人同时持有渤海汇金汇享益利率债 A 份额和渤海汇金汇享益利率债 C 份额。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	渤海汇金汇享益利率债 A	412,692.97	0.02%
	渤海汇金汇享益利率债 C	10.01	0.10%
	合计	412,702.98	0.02%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	渤海汇金汇享益利率债 A	0
	渤海汇金汇享益利率债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式 基金	渤海汇金汇享益利率债 A	10~50
	渤海汇金汇享益利率债 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	渤海汇金汇享益利率债 A	渤海汇金汇享益利率债 C
基金合同生效日（2024 年 01 月 24 日）基金 份额总额	2,179,998,399.46	3,044.54
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	493,258,102.51	30,476.70
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	971,328,465.25	23,940.89
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,701,928,036.72	9,580.35

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2024 年 1 月 20 日发布公告，自 2024 年 1 月 19 日起，麻众志先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的总经理助理。

2、本基金管理人于 2024 年 3 月 16 日发布公告，自 2024 年 3 月 15 日起，吴国威先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的总经理，原代任总经理齐朝晖先生离任。

3、本基金管理人于 2024 年 3 月 30 日发布公告，经管理人股东单位渤海证券股份有限公司决定，任命吴国威同志为公司董事，任期至公司第三届董事会届满。

4、本基金管理人于 2024 年 4 月 27 日发布公告，经管理人股东单位渤海证券股份有限公司决定，委派王延敏同志为公司第三届董事会独立董事，任期至公司第三届董事会任期届满之日止。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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高级管理人员受到稽查或者处罚的情况。

#### 10.6.2 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，托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	2	-	-	-	-	-

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
渤海证券	-	-	1,724,100,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加天天基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-01-11
2	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利得基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-01-15
3	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-01-16
4	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加中正达广基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-01-18
5	2024 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、证券日报	2024-01-20
6	关于渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金提前结束募集的公告	公司网站、证券日报	2024-01-24

7	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金基金合同生效公告	公司网站、证券日报	2024-01-25
8	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告	公司网站、证券日报	2024-01-26
9	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金增聘基金经理公告	公司网站、证券日报	2024-01-30
10	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）	公司网站	2024-01-31
11	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2024-01-31
12	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	公司网站	2024-01-31
13	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）及产品资料概要（更新）提示性公告	证券日报	2024-01-31
14	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧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、证券日报	2024-02-05
15	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加博时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、证券日报	2024-02-27
16	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-02-27
17	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-03-05
18	2024 年度渤海汇金证券资产管	公司网站、证券日报	2024-03-16

	理有限公司高级管理人员变更公告		
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上海万得基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-03-22
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上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-03-26
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平安银行股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-03-26
22	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	公司网站	2024-04-22
23	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告的提示性公告	证券日报	2024-04-22
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鼎信汇金（北京）投资管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、证券日报	2024-05-23
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和讯信息科技有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-05-31
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上海国信嘉利基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-05-31
27	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邮政储蓄银行股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站、证券日报	2024-06-21
28	渤海汇金证券资产管理有限公司	公司网站、证券日报	2024-06-26

	司关于旗下部分基金增加上海好买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		
29	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	公司网站	2024-06-26
30	渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	公司网站	2024-06-26
31	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下部分基金基金产品资料概要更新提示性公告	证券日报	2024-06-26

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20240124-20240630	599,999,500.00	-	-	599,999,500.00	35.25%
	2	20240124-20240630	499,999,500.00	-	-	499,999,500.00	29.38%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。</li> <li>2. 单一大额投资者大额赎回时为应对赎回证券变现产生的冲击成本的风险。</li> <li>3. 单一大额投资者退出后，可能出现迷你基金的情形，可能影响投资目标的实现。</li> <li>4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。</li> </ol>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金设立的文件；

- 2、《渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金在指定报刊上的各项公告。

## 12.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

## 12.3 查阅方式

上述文件可在渤海汇金证券资产管理有限公司网站或中国证监会基金电子披露网站上查阅，或者在营业时间内到渤海汇金证券资产管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-1717

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

二〇二四年八月三十一日