

# 渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

## 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:中泰证券股份有限公司

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。

基金托管人中泰证券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01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                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 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             | 12        |
| 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                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 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 | 13        |
| 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                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>34</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 34        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 35        |
| 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       | 36        |
| 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                    | 40        |
| 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      | 40        |
| 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   | 40        |
| 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                     | 41        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 41        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注.....                      | 41        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>              | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 42        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 42        |
| 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.....                   | 43        |
| 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.....   | 43        |
| 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>46</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..... | 46        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 46        |
| <b>§ 12 备查文件目录.....</b>                 | <b>46</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 46        |
| 12.2 存放地点.....                          | 46        |
| 12.3 查阅方式.....                          | 46        |

## § 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        |
| 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 03 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 | 31,873,934.75 份    |
| 基金合同存续期    | -                  |

### 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> <ol style="list-style-type: none"> <li>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；</li> <li>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</li> </ol> |

|  |   |
|--|---|
|  | <p>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。</p> <p>(四) 债券投资策略</p> <p>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。</p> |
|--|---|

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>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。</p> <p>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。</p> <p>此外，本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究，通过对转债品种的转股溢价率、纯债溢价率、到期收益率等指标分析，寻找具有债性支撑并且兼具一定股性的品种，捕捉其投资机会。可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。</p> <p>（五）股指期货、国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>（六）资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> |
| 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   | 吴国威                                    | 王秀荣                            |
|         | 联系电话 | 022-23861655                           | 0531-68889484                  |
|         | 电子邮箱 | liujia@bhhjamc.com                     | wangxr01@zts.com.cn            |
| 客户服务电话  |      | 400-651-1717                           | 95538                          |
| 传真      |      | 022-23861651                           | 0531-68889445                  |
| 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 | 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南山街道桂湾五路 128 号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 01 日-2024 年 06 月 30 日） |
|---------------|--|
| 本期已实现收益       | -7,314,992.70                          |
| 本期利润          | -8,960,085.27                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.2446                                |
| 本期加权平均净值利润率   | -32.67%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | -22.37%                                |
| 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      | -9,822,668.91                          |

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 期末可供分配基金份额利润        | -0.3082           |
| 期末基金资产净值            | 22,051,265.84     |
| 期末基金份额净值            | 0.6918            |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | 报告期末（2024年06月30日） |
| 基金份额累计净值增长率         | -30.82%           |

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、为降低迷你基金投资者负担，我司决定自 2024 年 5 月 16 日(含)起，由公司承担本基金迷你期间的相关固定费用（包括：信息披露费、审计费、基金份额持有人大会费、银行间账户维护费、注册登记费等）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | -9.07%   | 2.27%       | -2.68%     | 0.63%         | -6.39%  | 1.64% |
| 过去三个月      | -9.87%   | 2.39%       | -4.13%     | 0.81%         | -5.74%  | 1.58% |
| 过去六个月      | -22.37%  | 2.61%       | -5.95%     | 1.02%         | -16.42% | 1.59% |
| 过去一年       | -24.67%  | 1.98%       | -18.74%    | 0.92%         | -5.93%  | 1.06% |
| 过去三年       | -38.51%  | 1.57%       | -44.44%    | 1.00%         | 5.93%   | 0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | -30.82%  | 1.53%       | -35.62%    | 1.01%         | 4.80%   | 0.52% |

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

## 渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年03月23日-2024年06月30日)



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。

### 3.3 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)、渤海汇金汇亨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 |        |  |
| 何翔 | 公募权益部总经理兼公募权益部量化投资团队负责人、量化投资总监，本基金基金经理 | 2021-03-23      | -    | 20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。2023年4月担任公募权益部总经理兼公募权益部量化投资团队负责人、量化投资总监。2017年7月至2018年12月担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。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。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月起担任渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金经理。2021年12月28日起任渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金经理。 |

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

2、证券从业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

回顾 2024 年上半年市场表现，悲观预期短期集中释放促使 1 月至 2 月初市场经历了一轮快速下跌。而雪球产品敲入、私募基金平仓小微盘股因短时间交易拥挤引发流动性危机。春节后，伴随市场对经济预期修正、政策面积极催化以及小微盘流动性危机的化解，市场迎来大幅反弹。进入二季度，“新国九条”发布，退市新规下监管趋严，市场对中小市值公司担忧情绪上升，大小风格分化加剧。5 月下旬以来，随着市场对于经济预期的转弱，风险偏好持续收缩，市场成交清淡，呈现连续调整，资金进一步向防御板块聚集。上半年，以中证 A50、沪深 300 为代表的大盘蓝筹指数录得正收益，而中小微盘指数则大幅跑输，呈现不同程度下跌。行业方面，上半年涨幅居前的行业有银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化，跌幅居前的行业分别是综合、计算机、商贸零售、社会服务、传媒。

2024 年上半年，新动能基金坚持锚定中国经济新动能的长期确定性方向，聚焦新质生产力要求下的新兴产业，基于新动能主题相关的选股空间，通过多策略量化选股模型挖掘盈利能力和成长性的优质小盘股。面对市场波动及风格极致演绎，我们积极应对，持续优化完善策略，尽可能降低对产品净值带来的负面冲击。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末渤海汇金新动能主题混合基金份额净值为 0.6918 元，本报告期内，基金份额净值增长率为-22.37%，同期业绩比较基准收益率为-5.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场经历了前期震荡调整后，悲观情绪明显释放，当前市场估值处于历史较低位置。展望下半年，宏观层面，年初至今，国内经济延续回升向好态势，运行总体平稳，呈现外需强于内需，生产强于消费的特征。下半年外需增长或将保持韧性，内需增长有望温和修复，国内经济将延续回升向好态势。政策层面，三中全会明确了中长期改革发展的方向，同时重点关注短期经济形势，强调坚定不移实现全年经济社会发展目标，要落实好宏观政策，积极扩大国内需求，因地制宜发展新质生产力，加快培育外贸新动能。短期而言，改革及政策预期将有助于催化市场悲观预期的修复，而美国大选、美联储降息节奏等海外不确定因素仍将对市场形成扰动。中长期而言，伴随改革政策持续落地推动经济基本面持续修复，高质量发展优势不断积累以及严监管下市场生态逐步改善，市场有望走出底部蓄势阶段。

发展新质生产力是推动高质量发展的内在要求和重要着力点，受益于政策支持、产业转型升级、技术创新突破的新动能方向的中小企业中蕴含了较多的专精特新、小巨人公司，是发展新质生产力的重要方向，以这些优质中小企业为代表的小盘股同样具备较好的成长潜力和配置价值，未来伴随市场风险偏好逐步回升，这些公司的价格也将更具修复弹性。由于此前市场悲观情绪的极致演绎，我们跟踪到小盘股风险的自然出清使得其不同风格长期估值比较中已经显示相对较优，投资赔率优势是未来市场转化过程中需要耐心等待和把握的机遇。新动能基金仍将聚焦新质生产力要求下的新兴产业，基于新动能主题相关的选股空间，把握具有较高盈利质量和成长性的优质企业带来的超额收益。我们也将持续致力于策略优化完善和研发升级，提升挖掘和甄别优质公司能力，同时增强策略组合的适应性以及产品收益的稳定性。

#### 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 人的情况。本基金自 2022 年 6 月 23 日至 2024 年 6 月 30 日连续 490 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

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        | 上年度末 2023 年 12 月 31 日        |
|---------------|------------|-----------------------------|------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                             |                              |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 1,469,658.53                | 2,495,576.63                 |
| 结算备付金         |            | -                           | -                            |
| 存出保证金         |            | -                           | -                            |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 20,755,888.23               | 40,398,534.13                |
| 其中：股票投资       |            | 20,755,888.23               | 40,395,305.75                |
| 基金投资          |            | -                           | -                            |
| 债券投资          |            | -                           | 3,228.38                     |
| 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    | -                           | -                            |
| 应收清算款         |            | -                           | -                            |
| 应收股利          |            | -                           | -                            |
| 应收申购款         |            | 569.33                      | 2,532,734.07                 |
| 递延所得税资产       |            | -                           | -                            |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                           | -                            |
| 资产总计          |            | 22,226,116.09               | 45,426,844.83                |
| <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>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                             |                              |
| 短期借款          |            | -                           | -                            |
| 交易性金融负债       |            | -                           | -                            |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                           | -                            |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                           | -                            |
| 应付清算款         |            | -                           | -                            |
| 应付赎回款         |            | 119,246.52                  | 731,739.58                   |
| 应付管理人报酬       |            | 22,305.51                   | 37,158.72                    |
| 应付托管费         |            | 3,717.58                    | 6,193.13                     |
| 应付销售服务费       |            | -                           | -                            |
| 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    | 29,580.64                   | 10,000.00                    |
| 负债合计          |            | 174,850.25                  | 785,091.43                   |
| <b>净资产：</b>   |            |                             |                              |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 31,873,934.75               | 50,096,925.57                |

|          |         |               |               |
|----------|---------|---------------|---------------|
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | -9,822,668.91 | -5,455,172.17 |
| 净资产合计    |         | 22,051,265.84 | 44,641,753.40 |
| 负债和净资产总计 |         | 22,226,116.09 | 45,426,844.83 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.6918 元，基金份额总额 31,873,934.75 份。

## 6.2 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：2024 年 01 月 01 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 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|------------------------|------------|---------------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | -8,749,474.70                         | 6,299,052.66                               |
| 1. 利息收入                |            | 3,346.98                              | 2,719.37                                   |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.9    | 3,346.98                              | 2,719.37                                   |
| 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             |            | -                                     | -  |
| 其他利息收入                 |            | -                                     | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -7,246,885.81                         | 3,083,272.69                               |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.10   | -7,450,946.42                         | 2,802,289.84                               |
| 基金投资收益                 | 6.4.7.11   | -                                     | -  |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.12   | 654.13                                | 13,884.78                                  |
| 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   | 203,406.48                            | 267,098.07                                 |
| 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   | -1,645,092.57                         | 3,174,277.65                               |
| 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   | 139,156.70                            | 38,782.95                                  |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 210,610.57                            | 235,616.21                                 |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 162,366.83                            | 163,419.90                                 |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 27,061.10                             | 27,236.71                                  |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -                                     | -  |
| 4. 投资顾问费               |            | -                                     | -  |
| 5. 利息支出                |            | -                                     | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | -                                     | -  |

|                            |             |                  |                 |
|----------------------------|-------------|------------------|-----------------|
| 6. 信用减值损失                  | 6. 4. 7. 19 | -                | -               |
| 7. 税金及附加                   |             | -                | 0. 20           |
| 8. 其他费用                    | 6. 4. 7. 20 | 21, 182. 64      | 44, 959. 40     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |             | -8, 960, 085. 27 | 6, 063, 436. 45 |
| 减：所得税费用                    |             | -                | -               |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |             | -8, 960, 085. 27 | 6, 063, 436. 45 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |             | -                | -               |
| <b>六、综合收益总额</b>            |             | -8, 960, 085. 27 | 6, 063, 436. 45 |

### 6.3 净资产变动表

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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期 2024 年 01 月 01 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                                | 50, 096, 925. 57                           | -5, 455, 172. 17 | 44, 641, 753. 40  |
| 二、本期期初净资产                                | 50, 096, 925. 57                           | -5, 455, 172. 17 | 44, 641, 753. 40  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -18, 222, 990. 82                          | -4, 367, 496. 74 | -22, 590, 487. 56 |
| （一）、综合收益总额                               | -  | -8, 960, 085. 27 | -8, 960, 085. 27  |
| （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）      | -18, 222, 990. 82                          | 4, 592, 588. 53  | -13, 630, 402. 29 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 12, 094, 291. 57                           | -2, 636, 931. 08 | 9, 457, 360. 49   |
| 2. 基金赎回款                                 | -30, 317, 282. 39                          | 7, 229, 519. 61  | -23, 087, 762. 78 |
| （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                                | 31, 873, 934. 75                           | -9, 822, 668. 91 | 22, 051, 265. 84  |
| 项目                                       | 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 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                                | 34, 178, 212. 14                           | -9, 191, 397. 67 | 24, 986, 814. 47  |
| 二、本期期初净资产                                | 34, 178, 212. 14                           | -9, 191, 397. 67 | 24, 986, 814. 47  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -3, 580, 599. 29                           | 6, 692, 251. 63  | 3, 111, 652. 34   |
| （一）、综合收益总额                               | -  | 6, 063, 436. 45  | 6, 063, 436. 45   |
| （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）      | -3, 580, 599. 29                           | 628, 815. 18     | -2, 951, 784. 11  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 5, 825, 092. 76                            | -747, 787. 62    | 5, 077, 305. 14   |

|  |               |               |               |
|--|---------------|---------------|---------------|
| 2. 基金赎回款                                 | -9,405,692.05 | 1,376,602.80  | -8,029,089.25 |
| (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                                | 30,597,612.85 | -2,499,146.04 | 28,098,466.81 |

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 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(以下简称“中国证监会”)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%。

#### 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 1 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策

有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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股票、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) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(5) 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           | -                    |
| 等于：本金          | -                    |
| 加：应计利息         | -                    |
| 减：坏账准备         | -                    |
| 定期存款           | -                    |
| 等于：本金          | -                    |
| 加：应计利息         | -                    |
| 减：坏账准备         | -                    |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                    |
| 存款期限 1-3 个月    | -                    |
| 存款期限 3 个月以上    | -                    |
| 其他存款           | 1,469,658.53         |
| 等于：本金          | 1,469,565.46         |
| 加：应计利息         | 93.07                |

|        |              |
|--------|--------------|
| 减：坏账准备 | -            |
| 合计     | 1,469,658.53 |

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |      |               |             |
|---------------|----------------------|------|---------------|-------------|
|               | 成本                   | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动      |
| 股票            | 21,644,148.77        | -    | 20,755,888.23 | -888,260.54 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                    | -    | -             | -           |
| 债券            | 交易所市场                | -    | -             | -           |
|               | 银行间市场                | -    | -             | -           |
|               | 合计                   | -    | -             | -           |
| 资产支持证券        | -                    | -    | -             | -           |
| 基金            | -                    | -    | -             | -           |
| 其他            | -                    | -    | -             | -           |
| 合计            | 21,644,148.77        | -    | 20,755,888.23 | -888,260.54 |

#### 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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无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   | -         |
| 其中：交易所市场 | -         |
| 银行间市场    | -         |
| 应付利息     | -         |
| 预提费用     | 21,180.64 |
| 其他应付     | 8,400.00  |
| 合计       | 29,580.64 |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 50,096,925.57                         | 50,096,925.57  |
| 本期申购          | 12,094,291.57                         | 12,094,291.57  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -30,317,282.39                        | -30,317,282.39 |
| 本期末           | 31,873,934.75                         | 31,873,934.75  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | -906,901.93   | -4,548,270.24 | -5,455,172.17 |
| 本期期初           | -906,901.93   | -4,548,270.24 | -5,455,172.17 |
| 本期利润           | -7,314,992.70 | -1,645,092.57 | -8,960,085.27 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,775,371.97  | 2,817,216.56  | 4,592,588.53  |
| 其中：基金申购款       | -1,526,596.03 | -1,110,335.05 | -2,636,931.08 |
| 基金赎回款          | 3,301,968.00  | 3,927,551.61  | 7,229,519.61  |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | -6,446,522.66 | -3,376,146.25 | -9,822,668.91 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | -                                     |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | 3,346.98                              |
| 结算备付金利息收入 | -                                     |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 3,346.98                              |

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

**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**

单位：人民币元

| 项目         | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 127,286,421.27                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 134,481,272.48                        |
| 减：交易费用     | 256,095.21                            |
| 买卖股票差价收入   | -7,450,946.42                         |

**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 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------------------|---------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 44.74                                 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 609.39                                |
| 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                           | 654.13                                |

**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 01 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   | 3,428.97                              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,788.20                              |
| 减：应计利息总额               | 31.17                                 |
| 减：交易费用                 | 0.21                                  |
| 买卖债券差价收入               | 609.39                                |

**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

单位：人民币元

| 项目            | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 203,406.48                            |
| 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            | 203,406.48                            |

## 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 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -1,645,092.57                         |
| ——股票投资                 | -1,644,687.87                         |
| ——债券投资                 | -404.70                               |
| ——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                     | -1,645,092.57                         |

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 139,156.70                            |
| 合计      | 139,156.70                            |

## 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 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 2,601.68                              |
| 信息披露费   | 18,578.96                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行汇划费   | 2.00                                  |
| 合计      | 21,182.64                             |

**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<br>（“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：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**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |              | 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |              |
|-------|---------------------------------------|--------------|--|--------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额                                       | 占当期股票成交总额的比例 |
| 渤海证券  | 243,772,964.10                        | 100.00%      | 194,464,444.68                             | 100.00%      |

**6.4.10.1.2 权证交易**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |              | 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至<br>2023 年 06 月 30 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  | 1,132.26                                 | 33.32%       | 99,880.45                                     | 100.00%      |
| 中泰证券  | 2,265.54                                 | 66.68%       | -   | -            |

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日      |            |          |              |
|-------|--|------------|----------|--------------|
|       | 当期佣金                                       | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中泰证券  | 0.14                                       | 0.00%      | 0.00     | 0.00%        |
| 渤海证券  | 176,814.53                                 | 100.00%    | 0.00     | 0.00%        |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |            |          |              |
|       | 当期佣金                                       | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 渤海证券  | 141,098.08                                 | 100.00%    | 0.00     | 0.00%        |

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

#### 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 01 日至<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 01 月<br>01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 162,366.83                               | 163,419.90                                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 74,686.14                                | 74,093.97                                     |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 87,680.69                                | 89,325.93                                     |

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 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 01 月<br>01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 27,061.10                                | 27,236.71                                     |

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。

#### 6.4.10.2.3 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。

#### 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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                               | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 01 月<br>01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|----------------------------------|--|---|
| 基金合同生效日（2021 年 03 月 23 日）持有的基金份额 | -  | -   |
| 报告期初持有的基金份额                      | 1,001,291.67                             | 1,001,291.67                                  |
| 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      | -            | -            |
| 报告期末持有的基金份额         | 1,001,291.67 | 1,001,291.67 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 3.14%        | 3.27%        |

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金基金合同和招募说明书的规定执行。

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

注：本基金本报告期末及上年度可比期间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 01 日至<br>2024 年 06 月 30 日 |          | 上年度可比期间 2023 年 01 月<br>01 日至 2023 年 06 月 30 日 |          |
|------------|--|----------|---|----------|
|            | 期末余额                                     | 当期利息收入   | 期末余额  | 当期利息收入   |
| 渤海证券（其他存款） | 171,370.84                               | 2,037.42 | 337,627.70                                    | 1,086.37 |
| 中泰证券（其他存款） | 1,298,287.69                             | 1,309.56 | 1,293,305.96                                  | 1,633.01 |
| 中泰证券（活期存款） | -  | -        | -   | -0.01    |

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。

#### 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：本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末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，将风险控制在此可承受的范围之内。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA    | -                    | -                     |
| AAA 以下 | -                    | -                     |
| 未评级    | -                    | 3,228.38              |
| 合计     | -                    | 3,228.38              |

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。

#### 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。

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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年06<br>月30日 | 6个月以内        | 6个月-1<br>年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|------------------------|--------------|------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产                     |              |            |      |      |               |               |
| 货币资金                   | 1,469,658.53 | -          | -    | -    | -             | 1,469,658.53  |
| 交易性金融<br>资产            | -            | -          | -    | -    | 20,755,888.23 | 20,755,888.23 |
| 应收申购款                  | -            | -          | -    | -    | 569.33        | 569.33        |
| 资产总计                   | 1,469,658.53 | -          | -    | -    | 20,756,457.56 | 22,226,116.09 |
| 负债                     |              |            |      |      |               |               |
| 应付赎回款                  | -            | -          | -    | -    | 119,246.52    | 119,246.52    |
| 应付管理人<br>报酬            | -            | -          | -    | -    | 22,305.51     | 22,305.51     |
| 应付托管费                  | -            | -          | -    | -    | 3,717.58      | 3,717.58      |
| 其他负债                   | -            | -          | -    | -    | 29,580.64     | 29,580.64     |
| 负债总计                   | -            | -          | -    | -    | 174,850.25    | 174,850.25    |

|                             |              |             |       |          |               |               |
|-----------------------------|--------------|-------------|-------|----------|---------------|---------------|
| 利率敏感度缺口                     | 1,469,658.53 | -           | -     | -        | 20,581,607.31 | 22,051,265.84 |
| 上年度末<br>2023 年 12<br>月 31 日 | 6 个月以内       | 6 个月-1<br>年 | 1-5 年 | 5 年以上    | 不计息           | 合计            |
| 资产                          |              |             |       |          |               |               |
| 货币资金                        | 2,495,306.25 | -           | -     | -        | 270.38        | 2,495,576.63  |
| 交易性金融<br>资产                 | -            | -           | -     | 3,192.90 | 40,395,341.23 | 40,398,534.13 |
| 应收申购款                       | -            | -           | -     | -        | 2,532,734.07  | 2,532,734.07  |
| 资产总计                        | 2,495,306.25 | -           | -     | 3,192.90 | 42,928,345.68 | 45,426,844.83 |
| 负债                          |              |             |       |          |               |               |
| 应付赎回款                       | -            | -           | -     | -        | 731,739.58    | 731,739.58    |
| 应付管理人<br>报酬                 | -            | -           | -     | -        | 37,158.72     | 37,158.72     |
| 应付托管费                       | -            | -           | -     | -        | 6,193.13      | 6,193.13      |
| 其他负债                        | -            | -           | -     | -        | 10,000.00     | 10,000.00     |
| 负债总计                        | -            | -           | -     | -        | 785,091.43    | 785,091.43    |
| 利率敏感度<br>缺口                 | 2,495,306.25 | -           | -     | 3,192.90 | 42,143,254.25 | 44,641,753.40 |

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

| 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 2024 年 06 月 30 日        | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|    | 1. 市场利率上升 25 个基点   | -                           | -125.21               |
|    | 2. 市场利率下降 25 个基点   | -                           | 187.21                |

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易

的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |               | 上年度末 2023 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  | 20,755,888.23        | 94.13         | 40,395,305.75         | 90.49         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                    | -             | -                     | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                    | -             | 3,228.38              | 0.01          |
| 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            | 20,755,888.23        | 94.13         | 40,398,534.13         | 90.49         |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                       |
|----|----------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                       |
|    |                      | 本期末 2024 年 06 月 30 日        | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|    | 1. 业绩比较基准上升 5%       | -                           | 750,474.31            |
|    | 2. 业绩比较基准下降 5%       | -                           | -750,474.31           |

#### 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 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 第一层次          | 20,755,888.23        | 40,273,227.75         |
| 第二层次          | -                    | 125,306.38            |
| 第三层次          | -                    | -                     |
| 合计            | 20,755,888.23        | 40,398,534.13         |

##### 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应付款项等，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              | 20,755,888.23 | 93.39  |
|   | 其中：股票             | 20,755,888.23 | 93.39  |
| 2 | 基金投资              | -             | -      |
| 3 | 固定收益投资            | -             | -      |
|   | 其中：债券             | -             | -      |
|   | 资产支持证券            | -             | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -             | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -             | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -             | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 1,469,658.53  | 6.61   |
| 8 | 其他各项资产            | 569.33        | 0.00   |
| 9 | 合计                | 22,226,116.09 | 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

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 16,312,019.95 | 73.97        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 458,685.00    | 2.08         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| 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  | 3,048,137.28  | 13.82        |
| 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       | 93,940.00     | 0.43         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 843,106.00    | 3.82         |
| O  | 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               | 20,755,888.23 | 94.13        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值       | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|--------|------------|------------------|
| 1  | 688090 | 瑞松科技 | 20,720 | 565,656.00 | 2.57             |
| 2  | 688286 | 敏芯股份 | 10,000 | 476,000.00 | 2.16             |
| 3  | 300752 | 隆利科技 | 28,200 | 382,956.00 | 1.74             |
| 4  | 002296 | 辉煌科技 | 35,000 | 360,850.00 | 1.64             |
| 5  | 300100 | 双林股份 | 33,000 | 355,410.00 | 1.61             |
| 6  | 300306 | 远方信息 | 37,000 | 346,690.00 | 1.57             |
| 7  | 002161 | 远望谷  | 71,000 | 328,020.00 | 1.49             |
| 8  | 001336 | 楚环科技 | 15,000 | 327,750.00 | 1.49             |
| 9  | 002227 | 奥特迅  | 40,700 | 327,228.00 | 1.48             |
| 10 | 300936 | 中英科技 | 7,500  | 326,550.00 | 1.48             |
| 11 | 603725 | 天安新材 | 51,520 | 319,939.20 | 1.45             |
| 12 | 300307 | 慈星股份 | 53,000 | 315,350.00 | 1.43             |
| 13 | 600719 | 大连热电 | 31,000 | 309,690.00 | 1.40             |
| 14 | 605066 | 天正电气 | 55,500 | 309,135.00 | 1.40             |
| 15 | 002290 | 禾盛新材 | 23,000 | 306,360.00 | 1.39             |
| 16 | 300218 | 安利股份 | 20,000 | 301,600.00 | 1.37             |
| 17 | 301000 | 肇民科技 | 21,000 | 301,350.00 | 1.37             |
| 18 | 300279 | 和晶科技 | 71,900 | 299,823.00 | 1.36             |
| 19 | 300514 | 友讯达  | 19,500 | 295,035.00 | 1.34             |
| 20 | 300440 | 运达科技 | 56,000 | 294,000.00 | 1.33             |
| 21 | 688030 | 山石网科 | 28,000 | 292,600.00 | 1.33             |
| 22 | 300562 | 乐心医疗 | 32,000 | 285,120.00 | 1.29             |
| 23 | 603726 | 朗迪集团 | 21,000 | 281,400.00 | 1.28             |
| 24 | 688159 | 有方科技 | 7,300  | 276,378.00 | 1.25             |
| 25 | 688018 | 乐鑫科技 | 2,800  | 276,304.00 | 1.25             |
| 26 | 300417 | 南华仪器 | 33,100 | 274,399.00 | 1.24             |
| 27 | 688607 | 康众医疗 | 21,772 | 270,408.24 | 1.23             |
| 28 | 300422 | 博世科  | 54,000 | 257,040.00 | 1.17             |
| 29 | 688468 | 科美诊断 | 40,400 | 255,732.00 | 1.16             |
| 30 | 000880 | 潍柴重机 | 31,200 | 249,288.00 | 1.13             |
| 31 | 002996 | 顺博合金 | 40,820 | 238,797.00 | 1.08             |
| 32 | 600626 | 申达股份 | 98,600 | 238,612.00 | 1.08             |
| 33 | 688221 | 前沿生物 | 42,400 | 235,320.00 | 1.07             |
| 34 | 300150 | 世纪瑞尔 | 89,800 | 231,684.00 | 1.05             |
| 35 | 688226 | 威腾电气 | 13,000 | 227,240.00 | 1.03             |
| 36 | 002160 | 常铝股份 | 82,600 | 223,846.00 | 1.02             |
| 37 | 688081 | 兴图新科 | 25,000 | 220,000.00 | 1.00             |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 38 | 603111 | 康尼机电 | 36,400 | 211,848.00 | 0.96 |
| 39 | 688045 | 必易微  | 7,000  | 210,490.00 | 0.95 |
| 40 | 688335 | 复洁环保 | 25,200 | 205,380.00 | 0.93 |
| 41 | 300016 | 北陆药业 | 45,900 | 202,419.00 | 0.92 |
| 42 | 300333 | 兆日科技 | 40,900 | 197,547.00 | 0.90 |
| 43 | 300868 | 杰美特  | 9,300  | 194,835.00 | 0.88 |
| 44 | 002835 | 同为股份 | 11,500 | 194,235.00 | 0.88 |
| 45 | 688418 | 震有科技 | 11,200 | 191,856.00 | 0.87 |
| 46 | 002879 | 长缆科技 | 14,600 | 191,698.00 | 0.87 |
| 47 | 688189 | 南新制药 | 34,000 | 191,420.00 | 0.87 |
| 48 | 002887 | 绿茵生态 | 27,600 | 179,676.00 | 0.81 |
| 49 | 688246 | 嘉和美康 | 8,800  | 179,168.00 | 0.81 |
| 50 | 300103 | 达刚控股 | 40,000 | 178,800.00 | 0.81 |
| 51 | 301283 | 聚胶股份 | 6,300  | 178,731.00 | 0.81 |
| 52 | 300154 | 瑞凌股份 | 32,900 | 175,357.00 | 0.80 |
| 53 | 300550 | 和仁科技 | 18,400 | 173,880.00 | 0.79 |
| 54 | 002730 | 电光科技 | 23,300 | 164,032.00 | 0.74 |
| 55 | 300195 | 长荣股份 | 37,300 | 156,287.00 | 0.71 |
| 56 | 300610 | 晨化股份 | 17,600 | 154,352.00 | 0.70 |
| 57 | 300665 | 飞鹿股份 | 30,400 | 154,128.00 | 0.70 |
| 58 | 300950 | 德固特  | 10,000 | 152,400.00 | 0.69 |
| 59 | 300305 | 裕兴股份 | 25,602 | 151,307.82 | 0.69 |
| 60 | 002546 | 新联电子 | 45,900 | 149,175.00 | 0.68 |
| 61 | 300335 | 迪森股份 | 38,500 | 148,995.00 | 0.68 |
| 62 | 688601 | 力芯微  | 3,400  | 148,546.00 | 0.67 |
| 63 | 603320 | 迪贝电气 | 10,400 | 147,056.00 | 0.67 |
| 64 | 603903 | 中持股份 | 20,400 | 143,004.00 | 0.65 |
| 65 | 300241 | 瑞丰光电 | 34,200 | 140,220.00 | 0.64 |
| 66 | 603048 | 浙江黎明 | 9,500  | 137,940.00 | 0.63 |
| 67 | 300716 | 泉为科技 | 18,400 | 132,112.00 | 0.60 |
| 68 | 688077 | 大地熊  | 8,000  | 126,640.00 | 0.57 |
| 69 | 002396 | 星网锐捷 | 9,500  | 125,495.00 | 0.57 |
| 70 | 300259 | 新天科技 | 49,200 | 124,476.00 | 0.56 |
| 71 | 002442 | 龙星化工 | 28,800 | 123,840.00 | 0.56 |
| 72 | 301515 | 港通医疗 | 6,400  | 122,496.00 | 0.56 |
| 73 | 688232 | 新点软件 | 6,200  | 122,264.00 | 0.55 |
| 74 | 688227 | 品高股份 | 10,000 | 121,100.00 | 0.55 |
| 75 | 300377 | 赢时胜  | 23,700 | 120,396.00 | 0.55 |
| 76 | 002566 | 益盛药业 | 19,200 | 117,504.00 | 0.53 |
| 77 | 688162 | 巨一科技 | 6,000  | 116,880.00 | 0.53 |
| 78 | 688051 | 佳华科技 | 7,000  | 116,060.00 | 0.53 |
| 79 | 603039 | 泛微网络 | 3,400  | 107,984.00 | 0.49 |
| 80 | 688621 | 阳光诺和 | 2,200  | 93,940.00  | 0.43 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 81  | 300386 | 飞天诚信 | 8,600  | 89,526.00 | 0.41 |
| 82  | 300112 | 万讯自控 | 12,100 | 83,490.00 | 0.38 |
| 83  | 688087 | 英科再生 | 3,000  | 77,640.00 | 0.35 |
| 84  | 688533 | 上声电子 | 3,000  | 77,610.00 | 0.35 |
| 85  | 688613 | 奥精医疗 | 6,000  | 76,380.00 | 0.35 |
| 86  | 688011 | 新光光电 | 5,000  | 75,750.00 | 0.34 |
| 87  | 688314 | 康拓医疗 | 4,000  | 75,280.00 | 0.34 |
| 88  | 688129 | 东来技术 | 6,000  | 74,940.00 | 0.34 |
| 89  | 688127 | 蓝特光学 | 4,000  | 73,560.00 | 0.33 |
| 90  | 002970 | 锐明技术 | 2,000  | 72,060.00 | 0.33 |
| 91  | 688466 | 金科环境 | 6,000  | 71,520.00 | 0.32 |
| 92  | 688579 | 山大地纬 | 9,000  | 70,650.00 | 0.32 |
| 93  | 300743 | 天地数码 | 5,200  | 70,408.00 | 0.32 |
| 94  | 688026 | 洁特生物 | 7,000  | 69,720.00 | 0.32 |
| 95  | 688597 | 煜邦电力 | 10,000 | 69,600.00 | 0.32 |
| 96  | 688078 | 龙软科技 | 3,000  | 69,090.00 | 0.31 |
| 97  | 688656 | 浩欧博  | 2,995  | 68,675.35 | 0.31 |
| 98  | 688588 | 凌志软件 | 10,000 | 68,500.00 | 0.31 |
| 99  | 688501 | 青达环保 | 5,000  | 68,400.00 | 0.31 |
| 100 | 688718 | 唯赛勃  | 8,000  | 68,400.00 | 0.31 |
| 101 | 300816 | 艾可蓝  | 2,900  | 67,570.00 | 0.31 |
| 102 | 688069 | 德林海  | 5,000  | 67,200.00 | 0.30 |
| 103 | 688056 | 莱伯泰科 | 3,000  | 66,480.00 | 0.30 |
| 104 | 688089 | 嘉必优  | 5,000  | 66,200.00 | 0.30 |
| 105 | 688628 | 优利德  | 2,000  | 65,540.00 | 0.30 |
| 106 | 688138 | 清溢光电 | 3,000  | 64,500.00 | 0.29 |
| 107 | 688092 | 爱科科技 | 3,000  | 64,050.00 | 0.29 |
| 108 | 688638 | 誉辰智能 | 2,000  | 62,420.00 | 0.28 |
| 109 | 688671 | 碧兴物联 | 3,000  | 62,190.00 | 0.28 |
| 110 | 688393 | 安必平  | 4,000  | 61,320.00 | 0.28 |
| 111 | 688080 | 映翰通  | 2,000  | 60,660.00 | 0.28 |
| 112 | 688258 | 卓易信息 | 1,800  | 60,120.00 | 0.27 |
| 113 | 688316 | 青云科技 | 2,000  | 59,820.00 | 0.27 |
| 114 | 300428 | 立中集团 | 3,200  | 59,488.00 | 0.27 |
| 115 | 688296 | 和达科技 | 6,000  | 58,320.00 | 0.26 |
| 116 | 688208 | 道通科技 | 2,400  | 57,936.00 | 0.26 |
| 117 | 301056 | 森赫股份 | 7,500  | 57,525.00 | 0.26 |
| 118 | 301043 | 绿岛风  | 2,400  | 57,288.00 | 0.26 |
| 119 | 300929 | 华骐环保 | 7,800  | 57,096.00 | 0.26 |
| 120 | 688058 | 宝兰德  | 2,716  | 56,574.28 | 0.26 |
| 121 | 688155 | 先惠技术 | 1,400  | 55,356.00 | 0.25 |
| 122 | 688386 | 泛亚微透 | 1,939  | 54,408.34 | 0.25 |
| 123 | 300521 | 爱司凯  | 4,400  | 45,320.00 | 0.21 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 124 | 600847 | 万里股份 | 3,200 | 20,320.00 | 0.09 |
| 125 | 002540 | 亚太科技 | 3,300 | 17,457.00 | 0.08 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 300103 | 达刚控股 | 1,158,936.00 | 2.60            |
| 2  | 300243 | 瑞丰高材 | 1,142,231.00 | 2.56            |
| 3  | 600232 | 金鹰股份 | 941,838.00   | 2.11            |
| 4  | 300204 | 舒泰神  | 929,465.00   | 2.08            |
| 5  | 300562 | 乐心医疗 | 913,504.00   | 2.05            |
| 6  | 688168 | 安博通  | 910,087.10   | 2.04            |
| 7  | 300195 | 长荣股份 | 895,081.00   | 2.01            |
| 8  | 688336 | 三生国健 | 889,066.26   | 1.99            |
| 9  | 688189 | 南新制药 | 850,990.32   | 1.91            |
| 10 | 603086 | 先达股份 | 837,770.80   | 1.88            |
| 11 | 605066 | 天正电气 | 824,179.00   | 1.85            |
| 12 | 603045 | 福达合金 | 809,585.00   | 1.81            |
| 13 | 002753 | 永东股份 | 797,790.00   | 1.79            |
| 14 | 603111 | 康尼机电 | 769,078.00   | 1.72            |
| 15 | 300817 | 双飞集团 | 767,977.00   | 1.72            |
| 16 | 605288 | 凯迪股份 | 767,414.00   | 1.72            |
| 17 | 300246 | 宝莱特  | 749,583.00   | 1.68            |
| 18 | 300610 | 晨化股份 | 744,236.00   | 1.67            |
| 19 | 300753 | 爱朋医疗 | 743,770.00   | 1.67            |
| 20 | 300389 | 艾比森  | 729,646.00   | 1.63            |

注：本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 300243 | 瑞丰高材 | 1,337,937.00 | 3.00            |
| 2  | 688336 | 三生国健 | 1,165,963.33 | 2.61            |
| 3  | 300563 | 神宇股份 | 1,128,168.00 | 2.53            |
| 4  | 300254 | 仟源医药 | 1,120,321.00 | 2.51            |
| 5  | 600232 | 金鹰股份 | 1,029,984.00 | 2.31            |
| 6  | 300533 | 冰川网络 | 1,028,259.00 | 2.30            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 7  | 688168 | 安博通  | 997,955.97 | 2.24 |
| 8  | 300204 | 舒泰神  | 984,587.00 | 2.21 |
| 9  | 605288 | 凯迪股份 | 954,375.20 | 2.14 |
| 10 | 002870 | 香山股份 | 949,746.00 | 2.13 |
| 11 | 000533 | 顺钠股份 | 944,939.00 | 2.12 |
| 12 | 300389 | 艾比森  | 918,570.00 | 2.06 |
| 13 | 603045 | 福达合金 | 915,250.00 | 2.05 |
| 14 | 002753 | 永东股份 | 863,832.00 | 1.94 |
| 15 | 300093 | 金刚光伏 | 855,375.00 | 1.92 |
| 16 | 300103 | 达刚控股 | 852,322.00 | 1.91 |
| 17 | 600768 | 宁波富邦 | 851,914.00 | 1.91 |
| 18 | 300817 | 双飞集团 | 800,722.00 | 1.79 |
| 19 | 300195 | 长荣股份 | 778,952.00 | 1.74 |
| 20 | 603683 | 晶华新材 | 777,006.00 | 1.74 |

注：本项的“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 116,486,542.83 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 127,286,421.27 |

注：本项的“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金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

无

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 | 569.33 |
| 6  | 其他应收款 | -      |
| 7  | 待摊费用  | -      |
| 8  | 其他    | -      |
| 9  | 合计    | 569.33 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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 |
| 1,105        | 28,845.19     | 1,082,427.05 | 3.40%  | 30,791,507.70 | 96.60% |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份)   | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 2,336,229.28 | 7.33%    |

## 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                             | 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 开放式基金份额变动

单位：份

|                                   |                |
|-----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2021 年 03 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                      | 50,096,925.57  |
| 本报告期基金总申购份额                       | 12,094,291.57  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 30,317,282.39  |
| 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                      | 31,873,934.75  |

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，本基金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其高级管理人员受到稽查或处罚的情况。

### 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无受稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 渤海证券 | 2      | 243,772,964.10 | 100.00%      | 176,814.53 | 100.00%    | -  |
| 中泰证券 | 2      | -              | -            | 0.14       | 0.00%      | -  |

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

## 2、交易单元的选择标准和程序

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

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

3、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 | 1,132.26 | 33.32%       | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券 | 2,265.54 | 66.68%       | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

## 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  | 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、中国证券报 | 2024-01-20 |
| 2  | 渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告       | 公司网站       | 2024-01-22 |
| 3  | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告的提示性公告 | 中国证券报      | 2024-01-22 |
| 4  | 渤海汇金证券资产管理有限公司                          | 公司网站、中国证券报 | 2024-02-05 |

|    |   |            |            |
|----|---|------------|------------|
|    | 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                |            |            |
| 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、中国证券报 | 2024-03-16 |
| 6  | 渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2023 年年度报告                               | 公司网站       | 2024-03-29 |
| 7  | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告的提示性公告                         | 中国证券报      | 2024-03-30 |
| 8  | 渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金开放日常转换业务公告                                | 公司网站、中国证券报 | 2024-04-10 |
| 9  | 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大智慧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 | 2024-04-17 |
| 10 | 渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告                           | 公司网站       | 2024-04-22 |
| 11 | 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                     | 中国证券报      | 2024-04-22 |
| 12 | 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、中国证券报 | 2024-05-23 |
| 13 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加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、中国证券报 | 2024-05-31 |
| 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、中国证券报 | 2024-05-31 |
| 15 | 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       | 2024-06-26 |

|    |                                     |       |            |
|----|-------------------------------------|-------|------------|
| 16 | 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 | 中国证券报 | 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

注：无。

### 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。

### 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