

渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:2026 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中泰证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月27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2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49

7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 盈利投资者数量占比	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4 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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 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	46,894,351.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	渤海汇金新动能主题混合 A	渤海汇金新动能主题混合 C
下属分级基金的交易代码	010584	021364
报告期末下属分级基金的份额总额	38,725,106.71 份	8,169,244.44 份

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	（一）资产配置策略 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。 （二）新动能主题界定 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。 本基金拟投资的上市公司主要包括：

	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; 2) 通过发展新型能源、新型材料、新型生产工艺或构造新生产模式,在传统产业中对排放结构进行绿色化、低碳化、循环化的升级,或在传统产业中产业结构方面进行高端化、集群化、品牌化、信息化和智能化等转型的企业,在申银万国一级行业中相关行业包括:电力设备、机械设备、汽车、有色金属、基础化工、公用事业、环保; 3) 在包括医疗、教育、文化、娱乐等中高端消费中着力提升消费服务水平,或利用大数据等手段积极创造新兴业态模式的企业,在申银万国一级行业中相关的行业包括:医药生物、传媒、家用电器等。 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。 (三) 股票投资策略 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。 1、定量分析 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。 1) 估值水平 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。 2) 成长性 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。 3) 运营质量 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。 2、定性分析 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。 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。
--	---

	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。 (四) 债券投资策略 本基金在保障流动性的基础上, 有效利用基金资产进行债券投资, 以提高基金资产的投资收益。 首先, 通过对国内外宏观经济形势、财政政策、货币政策以及债券市场供求关系等因素的分析, 结合基金资产的流动性需求, 确定债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排。其次, 在上述约束条件下, 综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法, 结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素, 对个券进行积极的管理。 此外, 本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究, 通过对转债品种的转股溢价率、纯债溢价率、到期收益率等指标分析, 寻找具有债性支撑并且兼具一定股性的品种, 捕捉其投资机会。可交换债券与可转换债券的区别在于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。 (五) 股指期货、国债期货投资策略 本基金将在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 以套期保值为目的, 参与股指期货的投资。本基金将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征, 选择流动性较强、交易活跃的期货合约进行空头或多头套期保值, 以管理投资组合的系统性风险, 提高资金使用效率。 基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程, 确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作, 并明确相关岗位职责。此外, 基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组, 并授权特定的人员负责股指期货的投资审批事项。 基金管理人可运用国债期货, 以提高投资效率。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 参与国债期货的投资, 以管理投资组合的利率风险, 改善组合的风险收益特性。 (六) 资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济等多个因素的研究预测资产池未来现金流变化, 并通过研究标的证券发行条款, 预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时在严格控制风险的情况下, 综合运用多个策略和研究方法, 选择风险调整后收益高的品种进行投资, 以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中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	济南市高新区经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼
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	山东省济南市经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼 35 层
邮政编码		518054	250101
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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.bhhjamc.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	渤海汇金新动能主题混合 A	渤海汇金新动能主题混合 C
本期已实现收益	3,454,190.12	1,405,569.18
本期利润	-5,376,305.29	-689,989.71
加权平均基金份额本期利润	-0.1728	-0.0658
本期加权平均净值利润率	-12.56%	-4.78%

本期基金份额净值增长率	-7.46%	-7.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	7,039,286.14	1,417,242.27
期末可供分配基金份额利润	0.1818	0.1735
期末基金资产净值	45,764,392.85	9,586,486.71
期末基金份额净值	1.1818	1.1735
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	18.18%	32.12%

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

渤海汇金新动能主题混合 A 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
过去三个月	-12.94%	1.71%	41.26%	1.69%	-54.20%	0.02%
过去六个月	-7.46%	1.76%	37.53%	1.48%	-44.99%	0.28%
过去一年	10.05%	1.51%	82.12%	1.43%	-72.07%	0.08%
过去三年	28.69%	1.90%	75.78%	1.29%	-47.09%	0.61%
过去五年	5.04%	1.69%	20.19%	1.20%	-15.15%	0.49%
自基金合同生效起至今	18.18%	1.66%	39.26%	1.20%	-21.08%	0.46%

渤海汇金新动能主题混合 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
过去三个月	-13.05%	1.71%	41.26%	1.69%	-54.31%	0.02%
过去六个月	-7.69%	1.76%	37.53%	1.48%	-45.22%	0.28%
过去一年	9.49%	1.51%	82.12%	1.43%	-72.63%	0.08%
自基金合同生效起至今	32.12%	1.64%	88.62%	1.31%	-56.50%	0.33%

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
(2021年03月23日-2026年06月30日)



渤海汇金新动能主题混合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11月28日-2026年06月30日)



注：1、本基金合同于 2021 年 3 月 23 日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3、经与托管人协商一致，管理人决定自 2024 年 11 月 27 日起增设 C 类份额。C 类份额自首笔份额登记日（即 2024 年 11 月 28 日）起披露业绩数据。

§ 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 2026 年 06 月 30 日，本基金管理人共管理 20 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、渤海汇金优选价值混合型发起式证券投资基金、渤海汇金 1 个月持有期债券型发起式证券投资基金、渤海汇金鑫泉平衡混合型发起式证券投资基金、渤海汇金中证全指自由现金流指数发起式证券投资基金、渤海汇金多元积极配置 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(ETF-FOF)、渤海汇金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资基金、渤海汇金鑫享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	公募量化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	-	22 年	中国国籍，南开大学数学学士、金融学硕士，具有基金从业资格。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。现任公募量化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 月至 2024 年 12 月担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，为基金份额持有人谋求利益。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的行为。

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

2026 年上半年 A 股市场呈现明显结构分化行情，期间海外地缘冲突、全球流动性收紧预期对市场形成短期扰动。上半年科技成长赛道爆发式上涨，传统板块持续承压构成了 A 股市场的核心特征。市场整体流动性充裕，成交持续放量，融资活跃度处于高位。但在全球 AI 产业浪潮和国产替代的驱动下，资金极致定价“产业景气分化”，高度集中于半导体、算力、通信设备等科技领域。截至 2026 年 6 月 30 日，上半年科创 50、创业板指分别上涨 64.25%、35.58%，而上证指数仅小幅上涨 3.16%。行业方面，上半年涨幅居前的行业有电子、通信、建筑材料、机械设备，跌幅居前的行业分别是商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料、钢铁。

2026 年上半年，本基金延续新动能主题方向下的量化小微盘策略。年初震荡上升行情中小微盘表现强势，但此后市场呈现出结构极度分化的割裂现象，流动性虹吸效应的冲击下小微盘股遭遇了剧烈的调整，新动能基金净值也呈现一定幅度回撤。但我们认为这次调整是市场极致演化的短期现象，这种现象并不会一直持续，情绪与资金的极致演绎在凸显风险的同时也呈现了机遇。

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 A 基金份额净值为 1.1818 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.46%，同期业绩比较基准收益率为 37.53%；截至报告期末渤海汇金新动能主题混合 C 基金份额净值为 1.1735 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.69%，同期业绩比较基准收益率为 37.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在新旧动能加速转换、政策托底的大背景下，经济基本面仍将延续弱复苏格局。流动性方面，国内货币环境稳健偏宽松，A 股市场流动性总量上仍保持充裕，但鉴于增量资金难现集中爆发式增长，预计资金面仍以结构性博弈为主。风格层面，上半年在海外科技板块映射、AI 发展前景预期催化下 A 股市场科技主线与其他板块加剧分化，对资金形成明显集聚效应。尽管 AI 产业浪潮趋势仍在演进，但估值层面的快速提升可能导致短期透支预期的情形出现，也积累了较高的波动风险。从外部环境看，不确定性仍存，地缘冲突面临反复，美联储加息预期升温加剧全球流动性收紧的担忧，上述因素或将对 A 股流动性和风险偏好形成一定约束。综上，下半年 A 股市场整体仍以结构性行情为主。随着中报披露期来临，科技主线也将迎来高景气验证期，叠加前期高拥挤度以及外部环境扰动，市场波动将有所加大。同时科技主线的溢出效应或将促使其他板块局部修复，短期市场极度分化现象有望收敛。

经过二季度的大幅调整之后，A 股市场上的小微盘股已经呈现出了低估值、低杠杆、抵拥挤度的特征，我们有理由判断这是一个小微盘策略的底部区域，也是从中长期来看的一个极佳击球区域。从过往的历史回溯去看，我们的量化小微盘策略总有着较强的回撤收复能力，因此我们对于下半年策略组合能够逐步收复回撤也充满信心。

下面我想谈一谈最新的菲尔兹奖和我们投资关联的一些粗浅思考。

首先，借这份基金半年报祝贺中国籍数学家王虹和邓煜同时获得菲尔兹奖，这是我们中国人在数学领域的历史性突破，也是我们中国科技领域的骄傲。基础学科人才的涌现，正是我们迈向科技强国之路的实力展现。Deepseek 等 AI 大模型显著助推了这一轮科技产业的快速发展，这轮科技牛市背后那些新兴技术的创新也正是工程师红利和科学家红利的共同加持。李录先生在《文明、现代化、价值投资与中国》一书中阐述了我们可能正处在走向科技文明 3.0 的进程之中，而无论数学这样的基础科学还是 AI 这样的应用科学领域，科技人才持续涌现和不断的突破创新，也会加速我们科技强国的进程。归根到底，科学技术才是第一生产力，虽然短期难有立竿见影的效果，这一轮 AI 科技发展对当下经济的影响也还相对有限，但这些科技硬实力的持续发展更可能从长期对经济发展的质量带来深远影响。多年后我们再回看这一轮 AI 科技牛市的波澜起伏，兴许只是资本市场映射中国科技领域快速发展中的一个小注脚而已。

其次，如果把这次菲尔兹奖的几个难题映射到金融市场，大概也能找到些对于自己投资方法论的启发。从王虹解决的三维挂谷猜想去看，金融市场应该可以视作一个更复杂更高维的挂谷集，无数市场信号和因子构成了不同维度，由于降维可能面临的信息损失，在投资中采用多因子的方法则会是一种相对优势的选择，但过多的维度选择在投资中也会面临过拟合的可能。而从邓煜解决的希尔伯特第六问题去看，金融市场则是从微观混沌走向宏观秩序的典型代表，而且微观逻辑也应该能够最终导出宏观的秩序。因此，无论采用怎样的量化方法，我们在量化投资的过程中会更加重视对微观层面投资逻辑的挖掘和把握，这可能会让我们离最终战胜市场的目标更近一些。当然，投资终究是科学与艺术的融合体，面对复杂维度的金融市场，其实也很难简单的和一些数学问题去关联。而且即便降维可能会影响到实际效果，但过拟合的现实难题也需要不断去做平衡与取舍的艺术。努力将复杂问题简单化，仍是投资需要追求的优选路径。虽然这些思考难免会有偏颇之处，但这也是我们努力探究市场第一性原理、持续优化投资方法论的成长之路。未来我们还是会努力在自身投资方法上汲取更多的营养，持续优化迭代不断精进我们的量化策略，来提升基金组合的长期收益。

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

4.7 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的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 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：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	3,197,807.16	3,784,777.74
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	52,410,402.50	48,571,894.98
其中：股票投资		52,410,402.50	48,571,894.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		172,428.07	99,363.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		55,780,637.73	52,456,036.24
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
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		356,545.02	906,171.41
应付管理人报酬		58,860.27	64,500.07
应付托管费		9,810.03	10,750.03
应付销售服务费		4,534.85	10,363.95
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	8.00	-
负债合计		429,758.17	991,785.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	46,894,351.15	40,356,026.50
未分配利润	6.4.7.8	8,456,528.41	11,108,224.28
净资产合计		55,350,879.56	51,464,250.78
负债和净资产总计		55,780,637.73	52,456,036.24

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 46,894,351.15 份。其中渤海汇金新动能主题混

合 A 基金份额净值 1.1818 元，基金份额总额 38,725,106.71 份；渤海汇金新动能主题混合 C 基金份额净值 1.1735 元，基金份额总额 8,169,244.44 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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-5,633,323.77	12,108,935.38
1. 利息收入		6,709.39	4,711.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,709.39	4,711.19
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）		5,201,400.19	7,247,820.59
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,028,728.84	6,985,389.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	172,671.35	262,430.78
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-10,926,054.30	4,814,352.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	84,620.95	42,050.63
减：二、营业总支出		432,971.23	328,884.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	339,951.62	274,005.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,658.64	45,667.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	35,960.97	9,210.79
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	400.00	-

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-6,066,295.00	11,780,051.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,066,295.00	11,780,051.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,066,295.00	11,780,051.05

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：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026 年 01 月 01 日至 2026 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	40,356,026.50	11,108,224.28	51,464,250.78
二、本期期初净资产	40,356,026.50	11,108,224.28	51,464,250.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,538,324.65	-2,651,695.87	3,886,628.78
（一）、综合收益总额	-	-6,066,295.00	-6,066,295.00
（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）	6,538,324.65	3,414,599.13	9,952,923.78
其中：1. 基金申购款	39,804,661.03	15,695,873.97	55,500,535.00
2. 基金赎回款	-33,266,336.38	-12,281,274.84	-45,547,611.22
（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	46,894,351.15	8,456,528.41	55,350,879.56
项 目	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 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	40,481,505.40	-6,576,916.24	33,904,589.16
二、本期期初净资产	40,481,505.40	-6,576,916.24	33,904,589.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,962,261.71	9,925,200.27	14,887,461.98
（一）、综合收益总额	-	11,780,051.05	11,780,051.05
（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）	4,962,261.71	-1,854,850.78	3,107,410.93
其中：1. 基金申购款	22,195,237.59	-2,260,096.92	19,935,140.67
2. 基金赎回款	-17,232,975.88	405,246.14	-16,827,729.74

(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	45,443,767.11	3,348,284.03	48,792,051.14

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	吴国威	宁晓明
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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 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》、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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。
- (3) 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。
- (4) 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。
- (5) 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。

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 2026 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	3,197,807.16
等于：本金	3,197,395.50
加：应计利息	411.66
减：坏账准备	-
合计	3,197,807.16

注：其他存款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 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	63,406,514.28	-	52,410,402.50	-10,996,111.78
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	63,406,514.28	-	52,410,402.50	-10,996,111.78

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：本基金本报告期末无衍生金融工具。

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各项买入返售金融资产期末余额。

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：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	-
其他应付	8.00
合计	8.00

6.4.7.7 实收基金

渤海汇金新动能主题混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,504,050.26	27,504,050.26
本期申购	21,839,994.03	21,839,994.03
本期赎回（以“-”号填列）	-10,618,937.58	-10,618,937.58
本期末	38,725,106.71	38,725,106.71

渤海汇金新动能主题混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,851,976.24	12,851,976.24
本期申购	17,964,667.00	17,964,667.00
本期赎回（以“-”号填列）	-22,647,398.80	-22,647,398.80
本期末	8,169,244.44	8,169,244.44

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

渤海汇金新动能主题混合 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	8,062,564.89	-441,525.76	7,621,039.13
本期期初	8,062,564.89	-441,525.76	7,621,039.13
本期利润	3,454,190.12	-8,830,495.41	-5,376,305.29

本期基金份额交易产生的变动数	4,706,442.39	88,109.91	4,794,552.30
其中：基金申购款	8,839,293.21	-79,056.08	8,760,237.13
基金赎回款	-4,132,850.82	167,165.99	-3,965,684.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,223,197.40	-9,183,911.26	7,039,286.14

渤海汇金新动能主题混合 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	3,496,731.66	-9,546.51	3,487,185.15
本期期初	3,496,731.66	-9,546.51	3,487,185.15
本期利润	1,405,569.18	-2,095,558.89	-689,989.71
本期基金份额交易产生的变动数	-1,685,431.08	305,477.91	-1,379,953.17
其中：基金申购款	6,491,673.03	443,963.81	6,935,636.84
基金赎回款	-8,177,104.11	-138,485.90	-8,315,590.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,216,869.76	-1,799,627.49	1,417,242.27

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	6,554.08
结算备付金利息收入	-
其他	155.31
合计	6,709.39

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	97,959,199.15
减：卖出股票成本总额	92,787,930.68
减：交易费用	142,539.63
买卖股票差价收入	5,028,728.84

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 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 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。

6.4.7.11.4 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。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.12.2 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。

6.4.7.12.3 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。

6.4.7.12.4 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	172,671.35
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	172,671.35

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-10,926,054.30
——股票投资	-10,926,054.30
——债券投资	-
——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	-10,926,054.30

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	84,620.95
合计	84,620.95

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
证券账户开户费	400.00
合计	400.00

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

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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
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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	202,102,132.55	98.34%	219,777,830.43	100.00%
中泰证券	3,409,559.10	1.66%	-	-

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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

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

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 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	78,805.49	98.34%	-	-
中泰证券	1,329.72	1.66%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	85,746.99	100.00%	0.00	0.00%

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理	339,951.62	274,005.90

费		
其中：应支付销售机构的客户维护费	115,593.68	90,865.35
应支付基金管理人的净管理费	224,357.94	183,140.55

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,658.64	45,667.64

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	渤海汇金新动能主题混合 A	渤海汇金新动能主题混合 C	合计
渤海汇金资管	-	0.82	0.82
渤海证券	-	11,061.52	11,061.52
合计	-	11,062.34	11,062.34
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	渤海汇金新动能主题混合 A	渤海汇金新动能主题混合 C	合计
渤海汇金资管	-	1.81	1.81
渤海证券	-	8,298.72	8,298.72
合计	-	8,300.53	8,300.53

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资管，再由渤海汇金资管计算并支付给各基金销售机构。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E\times 0.50\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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固有资金投资本基金的情况

渤海汇金新动能主题混合 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	7,163,994.69	1,001,291.67
报告期间申购/买入总份额	6,693,089.91	13,974,139.89
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	13,857,084.60	14,975,431.56
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	35.78%	37.00%

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

渤海汇金新动能主题混合 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的基 金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
渤海证券	6,809,601.63	17.58%	-	-

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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）	2,843,377.47	6,338.22	1,491,500.78	4,171.11
中泰证券（其他存款）	354,429.69	215.86	1,211,476.95	539.95
中泰证券（活期存款）	-	-	0.00	0.13

注：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。
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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

金额单位：人民币元

股票 代码	股 票 名	停牌日期	停 牌 原	期 末 估	复牌日期	复 牌 开	数量 （股）	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
----------	-------------	------	-------------	-------------	------	-------------	-----------	------------	------------	----

	称		因	值 单 价		盘 单 价				
688121	*ST 卓然	2026-05-06	无法在法定期限内披露定期报告	6.48	2026-07-07	5.18	20,800	232,113.58	134,784.00	-

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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

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因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

公司建立了以董事会承担全面风险管理的最终责任，以审计委员会承担全面风险管理的监督责任，以经营层承担全面风险管理的主要责任，以首席风险官负责全面风险管理工作，以风险管理委

员会为风险管理工作指导机构，由各类型风险管理工作的主责部门为风险管理的归口管理部门，由各部门、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。公司应当赋予风险管理组织机构、人员足够的权限与资源，建立各部门、各分支机构、风险管理部门、内审部门之间密切协作、相互衔接、有效制衡的运行机制。

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。

6.4.13.3 流动性风险

报告期内本基金组合资产的流动性风险分析本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

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，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。

截至本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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						
货币资金	3,197,807.16	-	-	-	-	3,197,807.16
交易性金融 资产	-	-	-	-	52,410,402.50	52,410,402.50
应收申购款	-	-	-	-	172,428.07	172,428.07
资产总计	3,197,807.16	-	-	-	52,582,830.57	55,780,637.73
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	356,545.02	356,545.02
应付管理人 报酬	-	-	-	-	58,860.27	58,860.27
应付托管费	-	-	-	-	9,810.03	9,810.03
应付销售服 务费	-	-	-	-	4,534.85	4,534.85
其他负债	-	-	-	-	8.00	8.00
负债总计	-	-	-	-	429,758.17	429,758.17
利率敏感度 缺口	3,197,807.16	-	-	-	52,153,072.40	55,350,879.56
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	3,784,318.59	-	-	-	459.15	3,784,777.74
交易性金融 资产	-	-	-	-	48,571,894.98	48,571,894.98
应收申购款	-	-	-	-	99,363.52	99,363.52
资产总计	3,784,318.59	-	-	-	48,671,717.65	52,456,036.24
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	906,171.41	906,171.41
应付管理人 报酬	-	-	-	-	64,500.07	64,500.07
应付托管费	-	-	-	-	10,750.03	10,750.03
应付销售服 务费	-	-	-	-	10,363.95	10,363.95
负债总计	-	-	-	-	991,785.46	991,785.46
利率敏感度 缺口	3,784,318.59	-	-	-	47,679,932.19	51,464,250.78

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 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	52,410,402.50	94.69	48,571,894.98	94.38
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	52,410,402.50	94.69	48,571,894.98	94.38

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5；		
	2. 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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日

1. 业绩比较基准上升 5%	1, 928, 372. 29	2, 428, 594. 75
2. 业绩比较基准下降 5%	-1, 928, 372. 29	-2, 428, 594. 75

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	52, 275, 618. 50	48, 498, 534. 98
第二层次	134, 784. 00	73, 360. 00
第三层次	-	-
合计	52, 410, 402. 50	48, 571, 894. 98

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 2026 年 06 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、应收申购款及应付款项等，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	52,410,402.50	93.96
	其中：股票	52,410,402.50	93.96
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	3,197,807.16	5.73
8	其他各项资产	172,428.07	0.31
9	合计	55,780,637.73	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	27,500.00	0.05
B	采矿业	9,376.00	0.02
C	制造业	40,229,475.58	72.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	270,444.00	0.49
E	建筑业	15,260.00	0.03
F	批发和零售业	2,083,513.00	3.76
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	5,446,717.08	9.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	57,705.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	447,982.00	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	3,254,082.84	5.88

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	287,676.00	0.52
Q	卫生和社会工作	189,819.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	90,852.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	52,410,402.50	94.69

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	688659	元琛科技	78,756	822,212.64	1.49
2	688026	洁特生物	50,800	798,068.00	1.44
3	300126	锐奇股份	133,100	769,318.00	1.39
4	300112	万讯自控	121,900	754,561.00	1.36
5	002105	信隆健康	138,800	685,672.00	1.24
6	600202	哈空调	151,900	680,512.00	1.23
7	300665	飞鹿股份	66,500	680,295.00	1.23
8	300717	华信新材	31,600	673,080.00	1.22
9	688296	和达科技	58,282	666,746.08	1.20
10	301126	达嘉维康	75,500	645,525.00	1.17
11	002817	黄山胶囊	109,500	641,670.00	1.16
12	300929	华骐环保	60,600	638,724.00	1.15
13	688096	京源环保	46,340	619,102.40	1.12
14	688565	力源科技	65,344	617,500.80	1.12
15	300645	正元智慧	49,900	587,323.00	1.06
16	688056	莱伯泰科	9,000	580,950.00	1.05
17	688671	碧兴物联	16,000	569,120.00	1.03
18	002999	天禾股份	103,200	549,024.00	0.99
19	603168	莎普爱思	113,300	534,776.00	0.97
20	300535	达威股份	39,100	532,933.00	0.96
21	603282	亚光股份	36,800	525,136.00	0.95
22	688528	秦川物联	54,665	499,638.10	0.90
23	688681	科汇股份	35,456	495,674.88	0.90
24	301006	迈拓股份	39,400	494,470.00	0.89
25	300670	大烨智能	69,500	490,670.00	0.89
26	300605	恒锋信息	51,800	478,632.00	0.86
27	688329	艾隆科技	23,500	474,935.00	0.86
28	600303	曙光股份	187,800	467,622.00	0.84

29	688466	金科环境	36,300	465,729.00	0.84
30	688004	博汇科技	24,700	449,540.00	0.81
31	300163	先锋新材	82,600	441,084.00	0.80
32	301298	东利机械	36,800	425,776.00	0.77
33	603029	天鹅股份	30,200	424,612.00	0.77
34	300074	华平股份	122,600	416,840.00	0.75
35	002591	恒大高新	67,100	410,652.00	0.74
36	002873	新天药业	56,000	409,920.00	0.74
37	300958	建工修复	38,300	407,512.00	0.74
38	002535	林州重机	183,700	404,140.00	0.73
39	688078	龙软科技	18,700	393,635.00	0.71
40	603321	梅轮电梯	68,600	392,392.00	0.71
41	300334	津膜科技	37,400	389,708.00	0.70
42	300405	科隆股份	74,900	387,982.00	0.70
43	600099	林海股份	48,300	385,434.00	0.70
44	000757	浩物股份	112,000	381,920.00	0.69
45	688670	金迪克	22,400	379,456.00	0.69
46	603700	宁水集团	32,600	378,486.00	0.68
47	300514	友讯达	40,100	374,935.00	0.68
48	688695	中创股份	19,900	372,130.00	0.67
49	300417	南华仪器	36,000	369,360.00	0.67
50	002909	集泰股份	74,400	367,536.00	0.66
51	300305	裕兴股份	61,600	360,976.00	0.65
52	688089	嘉必优	33,900	359,679.00	0.65
53	688217	睿昂基因	16,700	345,022.00	0.62
54	300165	天瑞仪器	65,200	343,604.00	0.62
55	600847	万里股份	25,000	337,250.00	0.61
56	600774	汉商集团	53,800	336,788.00	0.61
57	300610	晨化股份	34,400	335,400.00	0.61
58	688426	康为世纪	17,700	324,618.00	0.59
59	688067	爱威科技	15,800	318,370.00	0.58
60	300387	富邦科技	46,500	315,735.00	0.57
61	300845	捷安高科	21,700	288,176.00	0.52
62	600455	博通股份	13,100	287,676.00	0.52
63	300614	百川畅银	29,700	287,496.00	0.52
64	300923	研奥股份	12,600	280,728.00	0.51
65	301037	保立佳	23,100	277,200.00	0.50
66	688038	中科通达	16,400	275,848.00	0.50
67	300838	浙江力诺	20,600	275,010.00	0.50
68	688573	信宇人	15,200	269,344.00	0.49
69	688420	美腾科技	12,700	267,589.00	0.48
70	301063	海锅股份	15,900	266,484.00	0.48
71	600768	宁波富邦	17,400	260,652.00	0.47

72	300412	迦南科技	57,000	259,920.00	0.47
73	002566	益盛药业	43,000	259,720.00	0.47
74	300549	优德精密	19,700	256,494.00	0.46
75	002760	凤形股份	15,600	256,152.00	0.46
76	600444	国机通用	19,600	254,408.00	0.46
77	003042	中农联合	20,900	253,935.00	0.46
78	301167	建研设计	19,900	246,561.00	0.45
79	688616	西力科技	24,300	245,430.00	0.44
80	000705	浙江震元	41,100	240,435.00	0.43
81	688058	宝兰德	11,000	230,120.00	0.42
82	002809	红墙股份	30,900	229,896.00	0.42
83	688092	爱科科技	10,700	227,268.00	0.41
84	688193	仁度生物	4,000	221,200.00	0.40
85	688393	安必平	12,400	220,472.00	0.40
86	603968	醋化股份	23,600	218,536.00	0.39
87	300961	深水海纳	16,800	215,880.00	0.39
88	688638	誉辰智能	6,900	215,073.00	0.39
89	688288	鸿泉技术	12,000	213,240.00	0.39
90	603073	彩蝶实业	14,300	213,213.00	0.39
91	000856	冀东装备	29,800	213,070.00	0.38
92	301515	港通医疗	12,100	212,113.00	0.38
93	300169	天晟新材	41,900	209,081.00	0.38
94	001336	楚环科技	9,400	206,988.00	0.37
95	603879	永悦科技	45,300	204,756.00	0.37
96	002715	登云股份	15,300	202,725.00	0.37
97	688793	倍轻松	12,400	199,764.00	0.36
98	300030	阳普医疗	32,700	189,987.00	0.34
99	002622	皓宸医疗	91,700	189,819.00	0.34
100	688701	卓锦股份	24,600	185,238.00	0.33
101	605177	东亚药业	10,600	181,366.00	0.33
102	000633	合金投资	37,900	180,404.00	0.33
103	002513	蓝丰生化	36,700	175,426.00	0.32
104	301131	聚赛龙	5,400	173,502.00	0.31
105	300721	怡达股份	4,600	173,190.00	0.31
106	002381	双箭股份	33,300	172,494.00	0.31
107	600671	天目药业	10,100	170,488.00	0.31
108	603177	德创环保	20,300	167,881.00	0.30
109	301163	宏德股份	7,500	166,350.00	0.30
110	688118	普元信息	8,200	164,984.00	0.30
111	301049	超越科技	9,200	164,312.00	0.30
112	688203	海正生材	16,400	163,672.00	0.30
113	688021	奥福科技	8,361	161,868.96	0.29
114	300556	丝路视觉	9,300	161,541.00	0.29

115	300615	欣天科技	16,000	160,480.00	0.29
116	301519	舜禹股份	13,800	149,730.00	0.27
117	301130	西点药业	6,200	148,676.00	0.27
118	603797	联泰环保	39,600	148,500.00	0.27
119	600149	廊坊发展	32,700	146,823.00	0.27
120	001231	农心科技	8,000	145,920.00	0.26
121	001260	坤泰股份	9,100	142,415.00	0.26
122	688121	*ST 卓然	20,800	134,784.00	0.24
123	300823	建科智能	9,100	132,678.00	0.24
124	603028	赛福天	20,500	132,635.00	0.24
125	603810	丰山集团	11,400	126,882.00	0.23
126	300195	长荣股份	21,500	126,205.00	0.23
127	300371	汇中股份	12,400	121,272.00	0.22
128	605069	正和生态	7,200	118,656.00	0.21
129	300597	吉大通信	16,400	116,112.00	0.21
130	002295	精艺股份	12,300	104,304.00	0.19
131	605001	威奥股份	19,100	104,095.00	0.19
132	601798	蓝科高新	14,100	102,084.00	0.18
133	688597	煜邦电力	15,600	101,400.00	0.18
134	301272	英华特	3,000	98,820.00	0.18
135	300937	药易购	5,000	96,450.00	0.17
136	301065	本立科技	5,400	95,310.00	0.17
137	603041	美思德	9,100	94,367.00	0.17
138	688395	正弦电气	4,200	92,820.00	0.17
139	600833	第一医药	10,000	90,200.00	0.16
140	300422	博世科	20,900	87,989.00	0.16
141	603023	威帝股份	23,100	86,163.00	0.16
142	002319	乐通股份	8,300	85,656.00	0.15
143	920118	太湖远大	4,500	83,700.00	0.15
144	600594	益佰制药	27,600	81,972.00	0.15
145	920832	齐鲁华信	13,400	78,122.00	0.14
146	300176	鸿特科技	16,000	77,600.00	0.14
147	002442	龙星科技	15,700	77,401.00	0.14
148	002388	新亚制程	14,500	75,980.00	0.14
149	000790	华神科技	21,500	75,035.00	0.14
150	688651	盛邦安全	2,300	74,106.00	0.13
151	920519	万德股份	8,200	73,882.00	0.13
152	001259	利仁科技	1,100	73,667.00	0.13
153	920527	夜光明	5,700	72,789.00	0.13
154	920266	生物谷	11,600	72,036.00	0.13
155	920719	宁新新材	8,200	71,996.00	0.13
156	002767	先锋电子	4,300	71,251.00	0.13
157	300509	新美星	8,500	71,230.00	0.13

158	920504	博迅生物	4,200	70,770.00	0.13
159	920873	中设咨询	10,300	70,246.00	0.13
160	301185	鸥玛软件	4,700	69,842.00	0.13
161	920300	辰光医疗	6,700	69,747.00	0.13
162	301072	中捷精工	1,700	69,717.00	0.13
163	002209	达意隆	6,700	69,546.00	0.13
164	301151	冠龙节能	4,200	69,300.00	0.13
165	003017	大洋生物	3,000	69,000.00	0.12
166	605186	健麾信息	2,200	68,992.00	0.12
167	300837	浙矿股份	2,900	68,904.00	0.12
168	301314	科瑞思	1,400	68,124.00	0.12
169	000952	广济药业	12,500	67,750.00	0.12
170	920057	百甲科技	15,100	67,195.00	0.12
171	920608	丰安股份	5,500	67,155.00	0.12
172	688113	联测科技	1,900	66,690.00	0.12
173	920679	前进科技	4,700	65,894.00	0.12
174	600831	广电网络	21,600	64,584.00	0.12
175	920030	德众汽车	15,600	64,584.00	0.12
176	300851	交大思诺	2,900	64,525.00	0.12
177	920260	中寰股份	8,900	64,436.00	0.12
178	920871	派特尔	6,100	63,867.00	0.12
179	001387	雪祺电气	5,000	63,850.00	0.12
180	920970	大禹生物	11,900	63,427.00	0.11
181	920267	鑫汇科	4,500	62,460.00	0.11
182	301378	通达海	2,600	62,348.00	0.11
183	920810	春光智能	8,000	62,080.00	0.11
184	300971	博亚精工	3,300	61,578.00	0.11
185	920422	润普食品	7,300	61,466.00	0.11
186	920414	欧普泰	7,500	60,825.00	0.11
187	300902	国安达	3,700	60,643.00	0.11
188	920895	花溪科技	5,300	60,314.00	0.11
189	920146	华阳变速	12,300	60,270.00	0.11
190	300642	透景生命	5,100	60,180.00	0.11
191	920149	旭杰科技	8,100	59,859.00	0.11
192	920717	瑞星股份	9,500	59,850.00	0.11
193	920370	新安洁	25,767	59,779.44	0.11
194	920931	无锡鼎邦	6,600	58,542.00	0.11
195	920580	科创新材	5,300	58,353.00	0.11
196	920132	泰鹏智能	7,800	58,344.00	0.11
197	920471	美邦科技	5,200	57,824.00	0.10
198	301503	智迪科技	2,100	57,771.00	0.10
199	300269	联建光电	10,400	57,304.00	0.10
200	000802	北京文化	16,300	56,724.00	0.10

201	300281	金明精机	9,400	56,682.00	0.10
202	688045	必易微	700	56,546.00	0.10
203	603880	南卫股份	8,000	56,480.00	0.10
204	300694	蠡湖股份	5,800	55,680.00	0.10
205	300784	利安科技	1,300	55,081.00	0.10
206	688369	致远互联	2,600	54,626.00	0.10
207	300637	扬帆新材	5,200	53,976.00	0.10
208	920145	恒合股份	5,600	53,928.00	0.10
209	688251	井松智能	2,100	53,823.00	0.10
210	002802	洪汇新材	5,100	53,652.00	0.10
211	002114	罗平锌电	7,400	53,502.00	0.10
212	002778	中晟高科	3,500	53,200.00	0.10
213	002700	万憬能源	8,400	52,248.00	0.09
214	920230	欧康医药	5,300	52,099.00	0.09
215	300155	安居宝	13,100	51,352.00	0.09
216	300103	达刚控股	6,600	50,622.00	0.09
217	301533	威马农机	2,100	49,686.00	0.09
218	001277	速达股份	1,800	49,662.00	0.09
219	300771	智莱科技	4,800	49,536.00	0.09
220	688060	云涌科技	1,500	49,335.00	0.09
221	920685	新芝生物	4,700	48,175.00	0.09
222	603331	百达精工	4,500	47,970.00	0.09
223	301107	瑜欣电子	2,240	47,712.00	0.09
224	300935	盈建科	1,600	46,944.00	0.08
225	300743	天地数码	3,200	46,688.00	0.08
226	920274	宏裕包材	3,000	46,650.00	0.08
227	920974	凯大催化	7,900	46,452.00	0.08
228	301270	汉仪股份	1,800	46,224.00	0.08
229	301158	德石股份	3,500	46,165.00	0.08
230	688244	永信至诚	3,200	45,632.00	0.08
231	301616	浙江华业	1,300	43,576.00	0.08
232	920802	保丽洁	4,300	42,269.00	0.08
233	920768	拾比佰	6,160	41,272.00	0.07
234	600719	大连热电	5,300	40,863.00	0.07
235	920641	格利尔	3,000	40,620.00	0.07
236	001324	长青科技	2,200	40,436.00	0.07
237	603917	合力科技	3,300	38,742.00	0.07
238	603188	亚邦股份	9,600	38,016.00	0.07
239	688178	万德斯	1,100	37,191.00	0.07
240	603617	君禾股份	5,200	37,024.00	0.07
241	920427	华维设计	3,900	36,660.00	0.07
242	920857	泓禧科技	2,700	36,315.00	0.07
243	002998	优彩资源	5,500	35,805.00	0.06

244	002551	尚荣医疗	13,300	35,511.00	0.06
245	002712	思美传媒	8,400	34,860.00	0.06
246	300928	华安鑫创	1,200	34,656.00	0.06
247	300519	新光药业	2,800	33,180.00	0.06
248	603356	华菱精工	2,000	33,040.00	0.06
249	688115	思林杰	400	32,900.00	0.06
250	000545	金浦钛业	13,700	32,606.00	0.06
251	300636	同和药业	5,100	32,487.00	0.06
252	300150	世纪瑞尔	8,100	32,157.00	0.06
253	600992	贵绳股份	3,700	31,894.00	0.06
254	002420	毅昌科技	5,800	31,552.00	0.06
255	600613	神奇制药	7,100	31,524.00	0.06
256	688069	德林海	840	31,382.40	0.06
257	300942	易瑞生物	5,300	30,634.00	0.06
258	603787	新日股份	3,300	29,997.00	0.05
259	603982	泉峰汽车	5,300	29,627.00	0.05
260	603768	常青股份	3,200	29,216.00	0.05
261	600241	时代万恒	4,500	29,205.00	0.05
262	688310	迈得医疗	1,900	29,203.00	0.05
263	002343	慈文传媒	6,600	28,776.00	0.05
264	000826	*ST 启环	15,000	28,650.00	0.05
265	000590	古汉医药	3,500	28,595.00	0.05
266	688030	山石网科	1,800	28,422.00	0.05
267	301418	协昌科技	500	27,940.00	0.05
268	301502	华阳智能	400	27,808.00	0.05
269	688255	凯尔达	1,000	27,800.00	0.05
270	600371	万向德农	4,400	27,500.00	0.05
271	688450	光格科技	400	26,796.00	0.05
272	301273	瑞晨环保	840	26,468.40	0.05
273	002753	永东股份	4,600	25,990.00	0.05
274	300824	北鼎股份	3,600	25,848.00	0.05
275	300534	陇神戎发	3,600	25,488.00	0.05
276	002576	通达动力	1,800	25,470.00	0.05
277	300707	威唐工业	2,200	24,596.00	0.04
278	603086	先达股份	4,600	23,874.00	0.04
279	002614	奥佳华	5,400	23,868.00	0.04
280	002022	科华生物	5,200	23,816.00	0.04
281	603335	迪生力	2,600	23,530.00	0.04
282	300994	久祺股份	2,200	23,474.00	0.04
283	301388	欣灵电气	1,000	23,320.00	0.04
284	301159	三维天地	800	23,280.00	0.04
285	301032	新柴股份	2,400	22,320.00	0.04
286	300025	华星创业	5,000	21,000.00	0.04

287	002748	世龙实业	2,000	20,960.00	0.04
288	002771	真视通	1,600	19,648.00	0.04
289	300335	迪森股份	4,000	19,480.00	0.04
290	301372	科净源	600	18,906.00	0.03
291	300382	斯莱克	800	18,488.00	0.03
292	603681	永冠新材	800	18,280.00	0.03
293	301512	智信精密	400	18,000.00	0.03
294	301290	东星医疗	600	16,350.00	0.03
295	300190	维尔利	3,900	16,185.00	0.03
296	688678	福立旺	640	15,468.80	0.03
297	603637	镇海股份	1,000	15,260.00	0.03
298	920469	富恒新材	2,600	14,508.00	0.03
299	688600	皖仪科技	400	13,312.00	0.02
300	688556	高测股份	1,000	13,280.00	0.02
301	920718	合肥高科	1,400	13,174.00	0.02
302	688153	唯捷创芯	400	12,848.00	0.02
303	000153	丰原药业	2,500	12,675.00	0.02
304	002587	奥拓电子	1,600	12,496.00	0.02
305	002009	天奇股份	600	12,408.00	0.02
306	300110	华仁药业	5,000	12,400.00	0.02
307	688518	联赢激光	400	12,360.00	0.02
308	300853	申昊科技	400	12,356.00	0.02
309	300249	依米康	800	12,320.00	0.02
310	300543	朗科智能	1,700	12,257.00	0.02
311	003027	同兴科技	700	12,201.00	0.02
312	688309	恒誉环保	200	12,176.00	0.02
313	603903	中持股份	900	12,141.00	0.02
314	920781	瑞奇智造	2,300	12,006.00	0.02
315	688468	科美诊断	2,100	11,949.00	0.02
316	002806	华锋股份	600	11,520.00	0.02
317	300907	康平科技	200	11,200.00	0.02
318	000509	华塑控股	3,000	11,190.00	0.02
319	001218	丽臣实业	500	11,030.00	0.02
320	002544	普天科技	600	10,932.00	0.02
321	688071	华依科技	300	10,932.00	0.02
322	603278	大业股份	1,000	10,870.00	0.02
323	603901	永创智能	1,000	10,870.00	0.02
324	300095	华伍股份	1,200	10,344.00	0.02
325	002115	三维通信	1,000	10,300.00	0.02
326	603185	弘元绿能	600	10,014.00	0.02
327	300369	绿盟科技	1,800	9,792.00	0.02
328	688377	迪威尔	400	9,432.00	0.02
329	000506	招金黄金	800	9,376.00	0.02

330	688557	兰剑智能	300	9,309.00	0.02
331	002685	华东重机	1,400	9,044.00	0.02
332	300036	超图软件	800	9,016.00	0.02
333	000990	诚志股份	1,100	8,998.00	0.02
334	300348	长亮科技	1,000	8,800.00	0.02
335	002888	惠威科技	400	8,792.00	0.02
336	688246	嘉和美康	400	8,220.00	0.01
337	688619	罗普特	500	8,115.00	0.01
338	300004	南风股份	800	8,080.00	0.01
339	002136	安纳达	600	7,848.00	0.01
340	603876	鼎胜新材	300	7,803.00	0.01
341	301166	优宁维	300	7,737.00	0.01
342	688355	明志科技	400	7,700.00	0.01
343	301487	盟固利	400	7,660.00	0.01
344	300818	耐普矿机	400	7,560.00	0.01
345	600333	长春燃气	1,500	7,530.00	0.01
346	688023	安恒信息	200	7,344.00	0.01
347	002890	弘宇股份	500	7,145.00	0.01
348	600052	东望时代	2,000	7,080.00	0.01
349	603190	亚通精工	300	6,786.00	0.01
350	300562	乐心医疗	500	6,755.00	0.01
351	301331	恩威医药	300	6,600.00	0.01
352	002425	凯撒文化	2,400	6,264.00	0.01
353	300219	鸿利智汇	600	6,258.00	0.01
354	603332	苏州龙杰	600	6,066.00	0.01
355	002633	申科股份	400	6,052.00	0.01
356	300154	瑞凌股份	800	6,016.00	0.01
357	600281	华阳新材	1,400	5,740.00	0.01
358	301192	泰祥股份	300	5,670.00	0.01
359	301156	美农生物	520	5,652.40	0.01
360	300317	珈伟新能	1,400	5,628.00	0.01
361	600386	北巴传媒	1,800	5,616.00	0.01
362	300612	宣亚国际	500	5,465.00	0.01
363	603096	新经典	400	5,352.00	0.01
364	600288	大恒科技	400	5,320.00	0.01
365	301578	辰奕智能	260	5,301.40	0.01
366	301082	久盛电气	580	5,196.80	0.01
367	300513	恒实科技	700	5,068.00	0.01
368	002237	恒邦股份	300	4,407.00	0.01
369	688148	芳源股份	500	4,290.00	0.01
370	000800	一汽解放	700	4,165.00	0.01
371	600579	中化装备	500	4,130.00	0.01
372	002793	罗欣药业	1,000	3,840.00	0.01

373	600469	风神股份	700	3,808.00	0.01
374	000949	新乡化纤	600	3,804.00	0.01
375	002386	天原股份	600	3,720.00	0.01
376	688108	赛诺医疗	200	3,706.00	0.01
377	300206	理邦仪器	300	3,669.00	0.01
378	000600	建投能源	400	3,500.00	0.01
379	002863	今飞凯达	800	3,392.00	0.01
380	000553	安道麦 A	600	3,210.00	0.01
381	002533	金杯电工	300	3,201.00	0.01
382	600590	泰豪科技	300	3,030.00	0.01
383	601956	东贝集团	600	2,772.00	0.01
384	600739	辽宁成大	200	2,022.00	0.00
385	600844	金煤科技	800	1,936.00	0.00

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	002105	信隆健康	1,251,320.00	2.43
2	300670	大烨智能	1,143,726.00	2.22
3	300112	万讯自控	1,108,167.00	2.15
4	300295	*ST 三六	1,096,821.00	2.13
5	603168	莎普爱思	1,077,629.00	2.09
6	300126	锐奇股份	1,045,427.00	2.03
7	301030	*ST 仕净	1,006,017.00	1.95
8	688189	ST 南新	943,411.88	1.83
9	002227	*ST 特迅	920,096.00	1.79
10	301126	达嘉维康	903,909.00	1.76
11	300074	华平股份	899,480.00	1.75
12	300645	正元智慧	878,336.00	1.71
13	688026	洁特生物	842,758.63	1.64
14	002591	恒大高新	821,206.00	1.60
15	688496	*ST 清越	816,851.09	1.59
16	300163	先锋新材	814,104.00	1.58
17	002873	新天药业	797,930.00	1.55
18	300665	飞鹿股份	778,265.00	1.51
19	603321	梅轮电梯	770,273.00	1.50
20	300305	裕兴股份	769,876.00	1.50

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	300246	宝莱特	1,604,684.00	3.12
2	603488	展鹏科技	1,184,803.00	2.30
3	002360	ST 同德	1,174,877.00	2.28
4	300845	捷安高科	1,071,342.00	2.08
5	002591	恒大高新	1,037,241.00	2.02
6	002809	红墙股份	1,035,868.00	2.01
7	301030	*ST 仕净	970,565.00	1.89
8	000826	*ST 启环	969,247.00	1.88
9	300295	*ST 三六	953,629.00	1.85
10	688189	ST 南新	944,553.32	1.84
11	688096	京源环保	928,125.71	1.80
12	000790	华神科技	902,753.00	1.75
13	688565	力源科技	852,251.40	1.66
14	300422	博世科	847,433.00	1.65
15	603023	威帝股份	840,042.00	1.63
16	300305	裕兴股份	820,091.00	1.59
17	300387	富邦科技	808,546.00	1.57
18	688496	*ST 清越	803,749.60	1.56
19	002227	*ST 特迅	798,112.00	1.55
20	600241	时代万恒	793,685.00	1.54

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	107,552,492.50
卖出股票收入（成交）总额	97,959,199.15

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

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

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

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	172,428.07

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	172,428.07

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

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
渤海汇金新动能主题混合 A	1,287	30,089.44	20,668,999.52	53.37%	18,056,107.19	46.63%
渤海汇金新动能主题混合 C	912	8,957.50	-	-	8,169,244.44	100.00%
合计	2,134	21,974.86	20,668,999.52	44.08%	26,225,351.63	55.92%

注：期末有 65 名基金份额持有人同时持有渤海汇金新动能主题混合 A 份额和渤海汇金新动能主题混合 C 份额。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	48.60%

8.3 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	占基金总份额比例
----	------	--------	----------

		(份)	
基金管理人所有从业人员持有本基金	渤海汇金新动能主题混合 A	2,647,931.85	6.84%
	渤海汇金新动能主题混合 C	4,256.77	0.05%
	合计	2,652,188.62	5.66%

8.4 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	渤海汇金新动能主题混合 A	>100
	渤海汇金新动能主题混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	渤海汇金新动能主题混合 A	>100
	渤海汇金新动能主题混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	渤海汇金新动能主题混合 A	渤海汇金新动能主题混合 C
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	27,504,050.26	12,851,976.24
本报告期基金总申购份额	21,839,994.03	17,964,667.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,618,937.58	22,647,398.80
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	38,725,106.71	8,169,244.44

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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动，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，无涉及基金财产的诉讼，无涉及公募基金托管业务的重大诉讼。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	202,102,132.55	98.34%	78,805.49	98.34%	-
中泰证券	3	3,409,559.10	1.66%	1,329.72	1.66%	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准：券商经营行为规范；具有较强的研究服务能力，包括研究及投资建议质量、报告的

及时性及服务质量；交易佣金收费合理。

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

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：本基金本报告期内新增的证券公司交易单元为中泰证券交易单元。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）》的报告期为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日，报告的主要内容是报告期间本公司旗下存续过的所有公募基金通过租用境内证券公司交易单元和委托境内证券公司进行证券投资及佣金支付情况，包括报告期间成立、清算、转型（如有）的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

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	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
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华宝证券作为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-02-03
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北京汇成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	中国证监会规定媒介	2026-02-11
5	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-12
6	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金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	中国证监会规定媒介	2026-03-26
7	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金增加北京新浪仓石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	中国证监会规定媒介	2026-03-26
8	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-30
9	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
10	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金	中国证监会规定媒介	2026-03-31

	2025 年年度报告的提示性公告	介	
11	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
12	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
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基煜基金销售公司作为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-30
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华夏财富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	中国证监会规定媒介	2026-06-11
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易方达财富（广州）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	中国证监会规定媒介	2026-06-12
16	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金增加汇添富基金销售（上海）有限公司作为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-29

§ 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	20260205-20260630	7,163,994.69	6,693,089.91	-	13,857,084.60	29.55%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。由此可能导致的特有风险主要包括： 1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。 2. 单一大额投资者大额赎回时为应对赎回证券变现产生的冲击成本的风险。 3. 单一大额投资者退出后，可能出现迷你基金的情形，可能影响投资目标的实现。 4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。							

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规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
二〇二六年八月三十一日