

**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)**

**2026 年第 3 季度报告**

2026 年 09 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:苏州银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 10 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人苏州银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 渤海汇金优选稳健 6 个月持有混合发起 (FOF)                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 基金主代码      | 019843                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金合同生效日    | 2023 年 11 月 27 日                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 报告期末基金份额总额 | 23,853,080.78 份                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 投资目标       | 在严格控制组合风险的前提下，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产，追求超越基金业绩比较基准的资产长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略       | <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金主要对国内外宏观经济环境、经济周期所处阶段、财政货币政策形势、证券市场走势、市场流动性等因素进行综合分析，判断各大类资产的中长期风险-收益特征和相对投资价值，结合本基金的投资目标、投资理念和风险控制要求，确定大类资产的中长期配置权重及调整区间。本基金将紧密跟踪市场环境的变化，结合组合绩效归因分析，对资产配置进行适时调整和优化。</p> <p>（二）基金投资策略</p> <p>基金投资策略分为权益类基金投资策略和固定收益类基金投资策略。</p> <p>1、 权益类基金投资策略</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>权益类基金包含主动型基金和指数型基金，前者包括股票型基金和混合型基金；后者包含普通指数型基金、增强指数型基金和 ETF。指数型权益类基金具有低成本优势，本基金对指数型基金的选择主要从标的基金所跟踪指数的走势研判及特征、跟踪误差、基金规模和流动性四方面来考量。主动型权益类基金的投资，主要运用多维度的基金评价分析方法，精选中长期业绩优秀且具有持续性、投资风格稳定的基金进行投资。</p> <p>定性分析方面通过对基金经理访谈或调研的方式进行，主要从基金产品、投资流程、基金管理团队、风险控制等维度进行评价。</p> <p>定量分析方面包括：</p> <p>（1）业绩分析：主要包括收益、风险、收益风险比等。</p> <p>（2）归因分析：主要包括择时能力、行业配置能力、选股能力等。</p> <p>（3）持仓分析：在行业配置层面，主要观察行业集中度、行业偏离度、行业轮换度等指标。</p> <p>（4）风险控制能力：主要考察下行标准差、区间最大回撤、信息比率等指标。</p> <p>2、固定收益类基金投资策略</p> <p>固定收益类基金的选择包括定性分析和定量分析两个维度。定性分析方面通过对基金经理访谈或调研的方式进行，主要从基金产品、投资流程、基金管理团队、风险控制等维度进行评价。而定量分析方面，除了分析基金的长中短期投资业绩、收益率波动性、最大回撤、风险调整后收益等指标外，还将分析标的基金的久期、投资杠杆和信用债的投资比例及结构，结合市场利率、收益率曲线和信用利差变动趋势的判断，分析组合的久期、杠杆水平以及信用风险暴露度。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>本基金在行业分析的基础上，会更加侧重用自下而上的方法精选个股。通过对上市公司的深度调研和分析，理清发展脉络，发现成长价值，在注重安全边际的基础上挑选具有长期竞争力的优质公司，通过股票池分级管理，精选核心投资标的。重点在于以下几个方面：</p> <p>1、定性分析：包括企业核心竞争优势、公司治理结构、管理层战略规划能力和经营团队管理能力等方面。</p> <p>2、定量分析：包括财务分析、市场占有率、盈利能力和成长能力等。主要参考业务收入增长率、利润增长率、净资产收益率（ROE）、毛利率等成长和盈利性指标。</p> <p>3、纵向比较：研究行业发展历史和公司发展历史，从而判断公司未来的发展前景。</p> <p>4、横向比较：对所研究上市公司的竞争对手、上下游关系进行比较分析，从而判断投资标的的价值。</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。本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。</p> <p>可转换债券和可交换债券同时具有债券与权益类证券的双重特性。本基金利用可转换债券及可交换债券的债券底价和到期收益率、信用风险来判断其债性，增强本金投资的安全性；利用可转换债券和可交换债券转股溢价率、基础股票基本面趋势和估值来判断其股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种。</p> <p>综合选择安全边际较高、基础股票基本面优良的品种进行投资，获取超额收益。</p> <p>同时，关注可转债和可交换债流动性、条款博弈、可转债套利等影响转债及可交换债投资的其他因素。</p> <p>（五）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          | 中债-新综合全价（总值）指数收益率×70%+中证 800 指数收益率×22%+中证商品期货成份指数收益率×3%+活期存款基准利率×5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                             |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金中基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金中基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                             |
| 基金管理人           | 渤海汇金证券资产管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                             |
| 基金托管人           | 苏州银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                             |
| 下属分级基金的基金简称     | 渤海汇金优选稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 渤海汇金优选稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C |
| 下属分级基金的交易代码     | 019843                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 019844                      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 23,829,638.40 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 23,442.38 份                 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标     | 报告期（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日） |                             |
|------------|----------------------------------------|-----------------------------|
|            | 渤海汇金优选稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A            | 渤海汇金优选稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C |
| 1. 本期已实现收益 | 158,101.25                             | 176.82                      |
| 2. 本期利润    | 307,012.65                             | 404.25                      |

|                 |               |           |
|-----------------|---------------|-----------|
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0129        | 0.0130    |
| 4. 期末基金资产净值     | 25,011,484.35 | 24,322.78 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0496        | 1.0376    |

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。

3.2 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

渤海汇金优选稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A 净值表现

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 1.24%      | 0.31%         | -3.18%         | 0.36%                 | 4.42%  | -0.05% |
| 过去六个月          | 0.35%      | 0.31%         | 0.52%          | 0.35%                 | -0.17% | -0.04% |
| 过去一年           | -2.97%     | 0.30%         | 0.31%          | 0.31%                 | -3.28% | -0.01% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 4.96%      | 0.25%         | 11.37%         | 0.30%                 | -6.41% | -0.05% |

渤海汇金优选稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C 净值表现

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 1.15%      | 0.31%         | -3.18%         | 0.36%                 | 4.33%  | -0.05% |
| 过去六个月          | 0.15%      | 0.31%         | 0.52%          | 0.35%                 | -0.37% | -0.04% |
| 过去一年           | -3.34%     | 0.30%         | 0.31%          | 0.31%                 | -3.65% | -0.01% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 3.76%      | 0.25%         | 11.37%         | 0.30%                 | -7.61% | -0.05% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

渤海汇金优选稳健6个月持有混合发起(FOF)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  
(2023年11月27日-2026年09月30日)



渤海汇金优选稳健6个月持有混合发起(FOF)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  
(2023年11月27日-2026年09月30日)



注：1、本基金合同于2023年11月27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、自2026年9月21日起，本基金业绩比较基准由“中债-综合全价（总值）指数收益率\*70%+中证800指数收益率\*25%+银行活期存款利率（税后）\*5%”调整为“中债-新综合全价（总值）指数收益率×70%+中证800指数收益率×22%+中证商品期货成份指数收益率×3%+活期存款基准利率×5%”。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-----|--------------------------|-------------|------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                          | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 徐益东 | 本基金基金经理                  | 2023-11-27  | -    | 8年     | 中国国籍，南开大学硕士，具有基金从业资格，5年以上投资、研究经历。历任渤海证券股份有限公司研究所研究员，渤海汇金证券资产管理有限公司研究部研究员、公募投资部基金经理助理，渤海汇金证券资产管理有限公司公募资产配置部基金经理。2023年6月12日至2026年6月12日担任渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金的基金经理。2023年11月27日担任渤海汇金优选稳健6个月持有期混合型发起式基金中基金的基金经理。                                                                                                  |
| 叶萌  | 公募资产配置部 FOF 投资总监，本基金基金经理 | 2023-11-27  | -    | 12年    | 中国国籍，金融学硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于东北证券股份有限公司资产管理总部、东证融汇证券资产管理有限公司、太平洋证券股份有限公司资产管理总部，从事基金产品研究和投资工作。2022年7月加入渤海汇金证券资产管理有限公司，任公募资产配置部 FOF 投资总监。2023年6月12日至2026年6月12日担任渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金的基金经理。2023年7月18日担任渤海汇金优选进取6个月持有期混合型发起式基金中基金的基金经理。2023年11月27日担任渤海汇金优选稳健6个月持有期混合型发起式基金中基金的基金经理。2026年5月21日担任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) 的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------|

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。

4.1.1 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《渤海汇金优选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 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 公平交易专项说明

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 032 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度国内权益市场整体呈现风格再平衡特征，成长板块经历明显估值消化，红利、周期风格相对占优。从主流指数看，红利低波全收益指数上涨 12.26%，而创业板指、科创 50 指数分别下行 27.80%、30.70%，市场板块分化显著。风格层面价值占优，沪深 300 纯价值指数上涨 7.91%，而沪深 300 纯成长指数下行 21.54%。行业层面，石油石化、煤炭等资源类受益于商品走强表现较好，分别上涨 15.32%、19.29%，而前期表现较强的电子、通信两大高景气赛道出现较大回调，分别下行 32.65%、28.72%，整体市场风险偏好下降。人民币口径下，同期港股大盘走强，恒生指数上涨 6.32%，

而恒生科技走弱，下行 5.99%；同样同期美股市场分化，人民币口径下，标普 500 微涨 0.89%、纳指 100 小幅下跌 0.68%，其中受人民币升值影响约-1.11%。商品层面，国内 SGE 黄金 9999 上涨 4.21%；债券方面，受益于实体需求偏弱，维持偏强，中债-7-10 年政策性金融债财富(总值)指数和中债-30 年期国债财富(总值)指数分别上涨 0.72%、3.03%。

报告期内，本基金的主要操作有：1) 在资产配置层面：本基金根据产品净值表现调整产品风险预算，并通过“资产性价比比较”的方法调整各类资产的相对配置比例。结合股债性价比指标判断，当前国内权益类资产相较债券类资产仍具备配置优势，因此在报告期末，本基金在产品风险预算约束下继续维持对权益类资产的超配比例；2) 在权益资产方面，本季度市场呈现明显的风格再平衡特征：成长板块经历阶段性估值消化，红利、周期类资产迎来估值修复行情。报告期内，本基金对价值方向持仓实施部分止盈操作，同时逢调整重新布局景气成长赛道，力争把握不同风格轮动下的结构性机会；3) 在债券资产方面，本基金延续二季度对二级债基的配置思路，持续优化固收资产结构，同时，组合整体维持短久期策略，保持较好的流动性储备，同时密切跟踪市场变化捕捉波段交易机会。报告期内，针对长久期利率债开展了适度的波段操作，在控制回撤的前提下增厚组合收益。

本基金是一只稳健型的普通 FOF 基金，权益类资产的配置中枢为 25%，本基金以中枢为战略资产配置，积极通过基金优选、战术资产配置等多策略实现超额收益。在资产配置层面，以配置中枢为基础，通过“资产性价比比较”的方法调整各类资产的相对配置比例以维持组合的不对称性。在基金优选层面，通过在长期维度能够持续创造 alpha 的基金经理中，选择不同投资策略和风格的基金进行分散化投资，使得超额收益来源更加多元化。在回撤控制层面，坚持结构调整优于仓位调整。本基金在组合管理过程中，将保持策略的稳定性，兼顾长期收益率和持续提升持有人体验，从而陪伴投资者实现财富增值。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末渤海汇金优选稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) A 基金份额净值为 1.0496 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.24%，同期业绩比较基准收益率为-3.18%；截至报告期末渤海汇金优选稳健 6 个月持有混合发起 (FOF) C 基金份额净值为 1.0376 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.15%，同期业绩比较基准收益率为-3.18%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|----|-------|---------------|
|----|----|-------|---------------|

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 1 | 权益投资              | -             | -      |
|   | 其中：股票             | -             | -      |
| 2 | 基金投资              | 20,314,935.34 | 81.08  |
| 3 | 固定收益投资            | 1,520,056.03  | 6.07   |
|   | 其中：债券             | 1,520,056.03  | 6.07   |
|   | 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          | 2,999,786.72  | 11.97  |
|   | 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      | 219,384.37    | 0.88   |
| 8 | 其他资产              | -             | -      |
| 9 | 合计                | 25,054,162.46 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 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。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 1,520,056.03 | 6.07         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 1,520,056.03 | 6.07         |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量(张)  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019792 | 25 国债 19 | 15,000 | 1,520,056.03 | 6.07         |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

不适用

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

不适用

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

注：本基金本报告期末无其他资产。

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称                      | 运作方式       | 持有份额<br>(份)      | 公允价值<br>(元)      | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) | 是否属于<br>基金管理<br>人及管理<br>人关联方<br>所管理的<br>基金 |
|----|--------|---------------------------|------------|------------------|------------------|-----------------------|--------------------------------------------|
| 1  | 511360 | 短融 ETF                    | 契约型开<br>放式 | 21,500.00        | 2,451,193<br>.50 | 9.79                  | 否                                          |
| 2  | 012233 | 招商安盈<br>债券 C              | 契约型开<br>放式 | 1,616,515<br>.63 | 1,912,984<br>.60 | 7.64                  | 否                                          |
| 3  | 009610 | 天弘永利<br>债券 C              | 契约型开<br>放式 | 1,627,758<br>.48 | 1,823,415<br>.05 | 7.28                  | 否                                          |
| 4  | 511700 | 场内货币<br>ETF               | 契约型开<br>放式 | 16,023.00        | 1,602,716<br>.60 | 6.40                  | 否                                          |
| 5  | 004011 | 华泰柏瑞<br>鼎利灵活<br>配置混合<br>C | 契约型开<br>放式 | 750,220.6<br>9   | 1,166,143<br>.04 | 4.66                  | 否                                          |

|    |        |                      |            |                     |                     |       |   |
|----|--------|----------------------|------------|---------------------|---------------------|-------|---|
| 6  | 003693 | 大成景尚<br>灵活配置<br>混合 C | 契约型开<br>放式 | 795, 983. 4<br>9    | 1, 057, 145<br>. 67 | 4. 22 | 否 |
| 7  | 008187 | 淳厚信睿<br>核心精选<br>混合 C | 契约型开<br>放式 | 228, 749. 0<br>2    | 963, 262. 1<br>2    | 3. 85 | 否 |
| 8  | 011066 | 大成高鑫<br>股票 C         | 契约型开<br>放式 | 194, 821. 5<br>1    | 918, 875. 6<br>5    | 3. 67 | 否 |
| 9  | 002010 | 中欧瑾通<br>灵活配置<br>混合 C | 契约型开<br>放式 | 615, 813. 8<br>8    | 903, 275. 8<br>0    | 3. 61 | 否 |
| 10 | 512000 | 券商 ETF               | 契约型开<br>放式 | 1, 600, 000<br>. 00 | 787, 200. 0<br>0    | 3. 14 | 否 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                       | 本期费用<br>2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09<br>月 30 日 | 其中：交易及持有基金管理人以<br>及管理人关联方所管理基金产生<br>的费用 |
|--------------------------|-----------------------------------------------|-----------------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费<br>(元)      | -                                             | -                                       |
| 当期交易基金产生的赎回费<br>(元)      | -                                             | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付<br>销售服务费(元) | 8, 290. 70                                    | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付<br>管理费(元)   | 29, 316. 33                                   | -                                       |
| 当期持有基金产生的应支付<br>托管费(元)   | 6, 898. 31                                    | -                                       |
| 当期交易基金产生的交易费<br>(元)      | 1, 252. 27                                    | -                                       |

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金持有的基金在报告期末未发生重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

|             |                                 |                                 |
|-------------|---------------------------------|---------------------------------|
|             | 渤海汇金优选稳健 6 个<br>月持有混合发起 (FOF) A | 渤海汇金优选稳健 6 个<br>月持有混合发起 (FOF) C |
| 报告期期初基金份额总额 | 23, 827, 518. 28                | 28, 602. 82                     |

|                           |               |           |
|---------------------------|---------------|-----------|
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,467.78      | 4,380.01  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 347.66        | 9,540.45  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             | -         |
| 报告期期末基金份额总额               | 23,829,638.40 | 23,442.38 |

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。

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 23,640,778.72 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 23,640,778.72 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 99.11         |

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金等交易情况。

## §9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限    |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|---------------|
| 基金管理人固有资金   | 23,640,778.72 | 99.11%       | 10,001,350.14 | 41.93%       | 自合同生效之日起不少于三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -            | -             | -            | -             |
| 基金经理等人员     | 35,993.57     | 0.15%        | -             | -            | -             |
| 基金管理人股东     | -             | -            | -             | -            | -             |
| 其他          | -             | -            | -             | -            | -             |
| 合计          | 23,676,772.29 | 99.26%       | 10,001,350.14 | 41.93%       | -             |

## §10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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              | 20260701-20260930       | 23,640,778.72 | -    | -    | 23,640,778.72 | 99.11% |
| 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：<br>1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。<br>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。<br>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。<br>4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。 |                |                         |               |      |      |               |        |

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、本基金管理人于 2026 年 8 月 1 日发布公告，自 2026 年 7 月 31 日起，吴国威先生代任渤海汇金证券资产管理有限公司的财务负责人，原财务负责人边燕萍女士离任。
- 2、报告期内，根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，经与基金托管人协商一致，本基金管理人决定自 2026 年 9 月 21 日起调整本基金的业绩比较基准，并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。具体有关事项详见基金管理人于 2026 年 8 月 21 日发布的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》。
- 3、本基金管理人于 2026 年 9 月 17 日发布公告，自 2026 年 9 月 16 日起，不再聘任德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计会计师事务所，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计会计师事务所。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金优选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 设立的文件；
- 2、《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) 基金合同》；
- 3、《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) 托管协议》；
- 4、《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) 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、渤海汇金优选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 在规定报刊上的各项公告。

## 11.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

## 11.3 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

二〇二六年十月二十七日