

渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式 证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期为 2021 年 08 月 10 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.11 投资组合报告附注	54
§9 基金份额持有人信息	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	55
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	55
§10 开放式基金份额变动	56
§11 重大事件揭示	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 其他重大事件	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息	61
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§13 备查文件目录	62
13.1 备查文件目录	62
13.2 存放地点	62
13.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	渤海汇金兴荣一年定期开放债券
场内简称	-
基金主代码	010848
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 10 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	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	509,999,500.00 份
基金合同存续期	-
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握债券市场的收益率变化，在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求为投资者提供稳健的回报。
投资策略	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>(1) 资产配置策略</p> <p>本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上，动态调整组合久期和债券的结构，并通过自下而上精选债券，获取优化收益。</p> <p>(2) 债券类金融工具投资策略</p> <p>1) 债券类金融工具类属配置策略</p> <p>类属配置是指对各市场及各种类的债券类金融工具之间的比例进行适时、动态的分配和调整，确定最能符合本基金风险收益特征的资产组合。具体包括市场配置和品种选择两个层面。</p> <p>在市场配置层面，本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据交易所市场和银行间市场等市场债券类金融工具的到期收益率变化、流动性变化和市场规模等情况，择机调整不同市场中债券类金融工具所占的投资比例。</p> <p>在品种选择层面，本基金将基于各品种债券类金融工具收益率水平的变化特征、宏观经济预测分析以及税收因素的影响，综合考虑流动性、收益性等因素，采取定量分析和定性分析结合的方法，在各种债券类金融工具之间进行优化配置。</p>

	<p>2) 久期调整策略</p> <p>债券投资受利率风险的影响。本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。</p> <p>当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期值，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升收益；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以规避债券价格下降的风险带来的资本损失，获得较高的再投资收益。</p> <p>3) 收益率曲线配置策略</p> <p>本基金将综合考察收益率曲线和信用利差曲线，通过预期收益率曲线形态变化和信用利差曲线走势来调整投资组合的头寸。</p> <p>在考察收益率曲线的基础上，本基金将确定采用集中策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变和不同期限信用债券的相对价格变化中获利。一般而言，当预期收益率曲线变陡时，本基金将采用集中策略；当预期收益率曲线变平时，将采用哑铃策略；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采用梯形策略。</p> <p>本基金还将通过研究影响信用利差曲线的经济周期、市场供求关系和流动性变化等因素，确定信用债券的行业配置和各信用级别信用债券所占投资比例。</p> <p>4) 基于信用变化策略</p> <p>信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基金将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析和公司发展前景分析等细致的调查研究，依靠本基金内部信用评级系统建立信用债券的内部评级，分析违约风险及合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。</p> <p>5) 息差策略</p> <p>当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购并将所融入的资金投资于债券，从而获取债券收益率超出回购资金成本（即回购利率）的套利价值。</p> <p>6) 信用债券精选策略</p> <p>本基金将根据信用债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，建立不同品种的收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，重点选择具备以下特征的信用债券：较高到期收益率、较高当期收入、价值被低估、预期信用质量将改善、期权和债权突出、</p>
--	--

	<p>属于创新品种而价值尚未被市场充分发现。</p> <p>本基金可投资的信用债评级须在 AA（含 AA）以上，除短期融资券、超短期融资券以外的信用债采用债项评级，短期融资券、超短期融资券采用主体评级。其中：AA 评级债券投资占比不超过本基金投资信用债资产的 20%；AA+评级债券投资占比不超过本基金投资信用债资产的 70%；AAA 及以上评级债券投资占比不低于本基金投资信用债资产的 30%。</p> <p>本基金对信用债券评级的认定参照基金管理人选定的评级机构出具的债券信用评级。</p> <p>7) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。</p> <p>8) 国债期货投资策略</p> <p>本基金将认真研究国债期货市场运行特征，根据风险管理的原则以套期保值为目的，使用该类投资工具，提高组合收益。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		渤海汇金证券资产管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	麻众志	龚小武
	联系电话	010-68784289	021-52629999-212056
	电子邮箱	mazz@bhzq.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-651-5988/ 400-651-1717	95561
传真		022-23861651	021-62159217

注册地址	深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	福州市湖东路 154 号
办公地址	深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	518054	200120
法定代表人	刘嫣	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	https://www.bhhjamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	渤海汇金证券资产管理有限公司	天津市南开区宾水西道 8 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年8月10日 (基金合同生效 日)-2021年12月 31日	2020年	2019年
本期已实现收益	6,193,121.42	-	-
本期利润	8,519,001.42	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0167	-	-
本期加权平均净值利润率	1.66%	-	-
本期基金份额净值增长率	1.67%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	6,193,121.42	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0121	-	-
期末基金资产净值	518,518,501.42	-	-
期末基金份额净值	1.0167	-	-
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	1.67%	-	-

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同于 2021 年 8 月 10 日生效，截至本报告期末成立未满 1 年，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

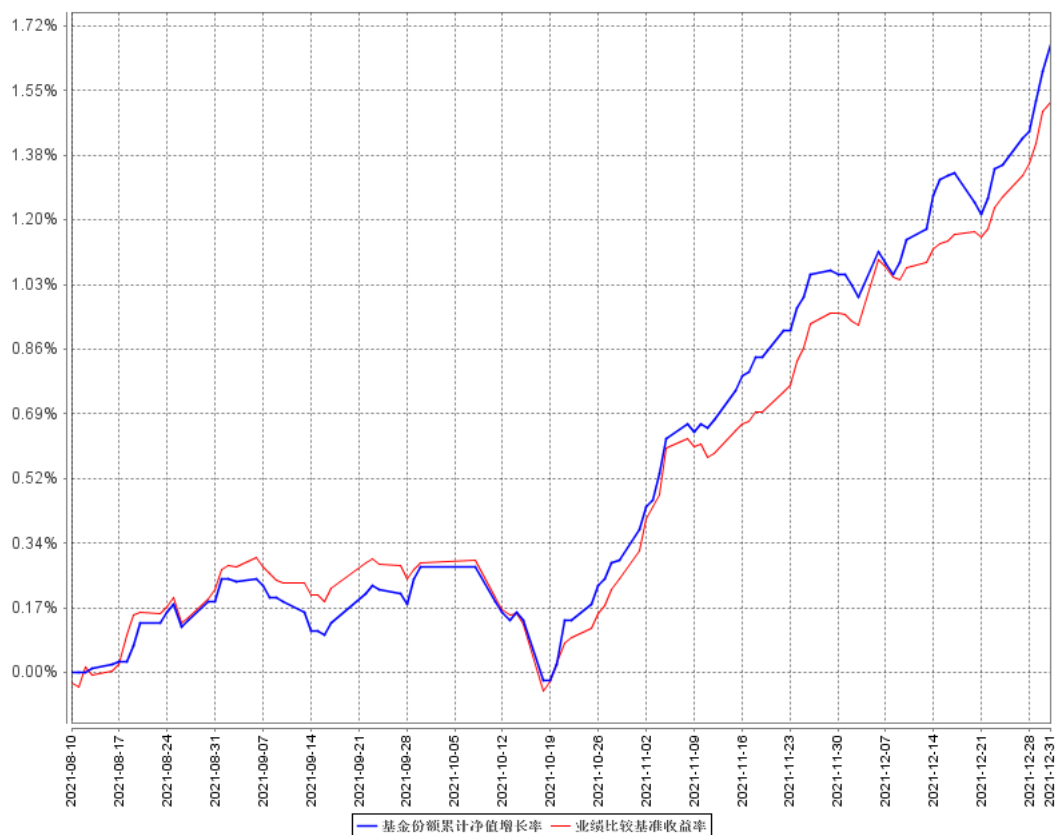
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.39%	0.05%	1.22%	0.05%	0.17%	0.00%
自基金合同 生效起至今	1.67%	0.04%	1.52%	0.04%	0.15%	0.00%

注：业绩比较基准：中债综合财富(总值)指数收益率。

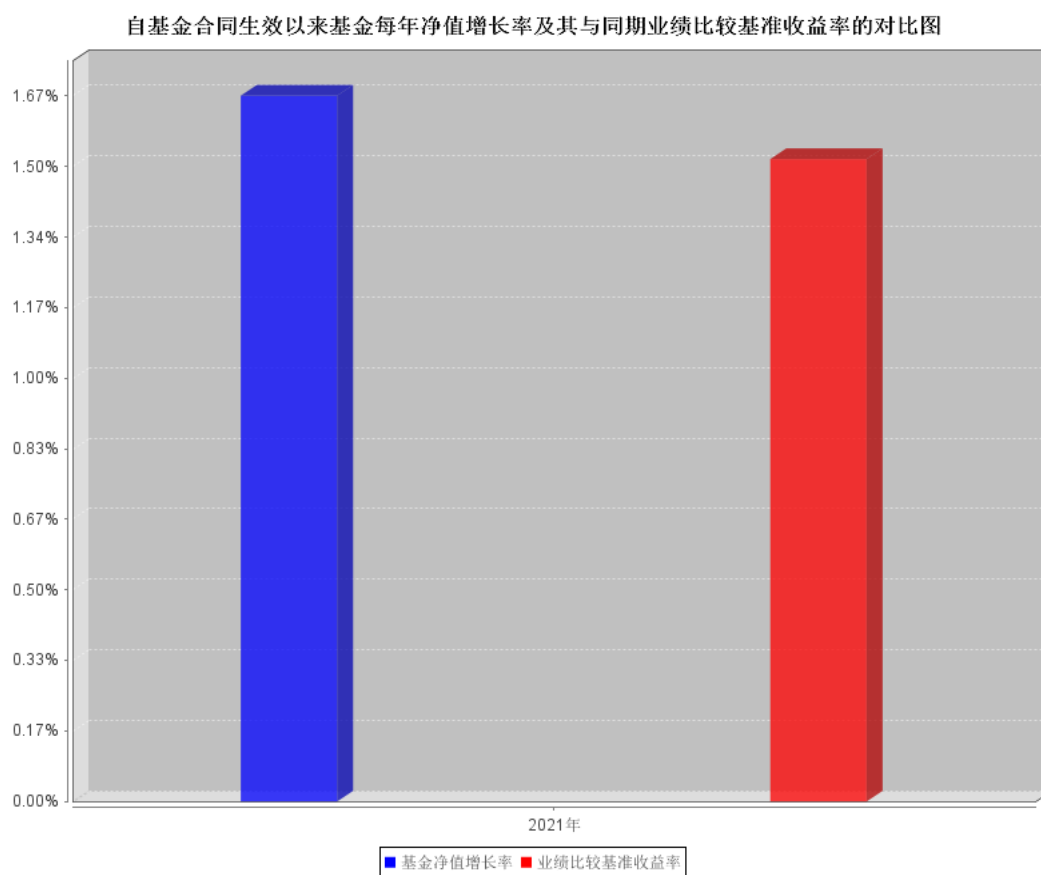
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 8 月 10 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年；
2、自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚处于建仓期。

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



注：本基金合同于 2021 年 8 月 10 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 10 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、渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金、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。

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		
李杨	本基金的基金经理	2021 年 8 月 13 日	-	5 年	天津财经大学经济学学士。2011 年 10 月到 2014 年 4 月，在包商银行股份有限公司任债券交易员，2014 年 5 月到 2016 年 8 月，在天津银行股份有限公司任债券交易员，2016 年 9 月至今，在渤海汇金证券资产管理有限公司任基金经理。2017 年 8 月至 2021 年 8 月任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2017 年 12 月起任渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2017 年 12 月起任渤海汇金汇添益 3 个月定期开放

					债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年2月起担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2020年11月起担任渤海汇金汇裕87个月定开基金基金经理。2021年8月起任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
高延龙	本基金的基金经理	2021年8月10日	-	1年	墨尔本大学金融学硕士，特许金融分析师(CFA)，2013年3月至2015年3月就职于联合资信评估有限公司，任分析师。2015年3月至2016年1月就职于国开城市交通投资发展基金，任投资经理。2016年2月至2020年3月就职于渤海人寿保险股份有限公司，任债券投资经理。2020年3月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，2020年6月起任渤海汇金汇增利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020年8月起任汇添金货币市场基金基金经理。2020年11月起担任渤海汇金汇裕87个月定开基金基金经理。2021年8月起任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

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

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

围的相关规定

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

4.1.4 基金经理薪酬机制

不涉及

4.2 管理人对报告期内本基金运作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《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司《渤海汇金证券资产管理有限公司公募业务公平交易制度》，以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现，结合盘中实时监控，事后分析和信息披露等风险控制措施加强对于公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合在获得投资信息、投资建议和实时投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对投资指令进行综合平衡，保证交易在各资产组合间的公平执行，保证各类投资人得到公平对待。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

不涉及

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，报告期内，本基金未发现异常交易行为，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交的单边交易量超过该证券交易当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年债券市场走出一波小牛市，10 年国债收益下行 36bps，10 年国开收益下行 45bps。分阶段看，年初至 2 月中旬，由于央行整体投放规模不及市场预期，资金利率飙升；春节期间海外经济延续修复、美国市场通胀预期升温，美债收益率快速上行。在上述综合影响下国债收益率上行至年内高点 3.28% 附近。2 月中下旬至 8 月初，债券收益重回下行轨道，主要影响因素为资金面转稳，地方债供给不及预期以及机构的资产欠配。特别在 7 月初央行超预期降准后，做多热情彻底点燃，10 年国债收益大幅下行突破 2.8%。虽然 8 月至 10 月中旬由于市场交易逻辑转向滞涨，收益有 20bps 回调，但在资金面宽松，经济下行压力显现，O 型病毒爆发，风险偏好降低等多种因素作用下，收益再次下行，10 年国债收在了全年低点附近。

报告期内主要配置了中短端政金债，并通过一定的杠杆操作增加套息收益。阶段性参与长端债券的交易，博取价差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0167 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.67%，业绩比较基准收益率为 1.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前利率债绝对收益水平较低，想象空间有限。但是短期内经济下行压力依然存在，资金面依然保持宽松，出现大幅回调的可能性也较低。债券收益将受宽信用和宽货币两方面影响而波动，后期需要观察对冲地产链下行的政策力度。海外需要关注主要经济体加息的进度。目前资金面维持宽松概率较大，短久期套息策略对于组合收益的贡献较为确定。经济以“稳”为主的情况下，如果市场出现大幅回调，可以参与长债的交易，博取价差。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作以法律法规、行业规范和公司制度为依据，对基金的投资、交易、运营等环节，实施事前、事中和事后的风险管理，努力做到防范和控制风险，保证合法合规、健康持续经营，保护投资者合法权益。

本报告期内，主要监察稽核工作如下：

(1) 本基金管理人加快建设“合规、诚信、专业、稳健”的企业文化，完善制度建设及工作机制。加强对重大决策、新产品、新业务及重要业务活动等的合规审查工作，有效防范和化解了相关的合规风险。

按照监管要求，完成反洗钱工作报告及报表、非居民金融账户涉税尽职调查等工作。组织开

展客户适当性管理、廉洁从业、债券投资交易等多项检查。组织开展反洗钱专项等合规培训，增加合规培训覆盖面和培训力度，提升公司整体合规意识。

(2) 本基金管理人的风险控制工作结合市场情况和监管要求，根据业务类型特点及风险管理的需要，不断完善风险管理组织架构。制定公司总体风险偏好、风险限额，并根据业务需求对各类风险限额进行分解及动态管理，全年未出现超出限额的重大风险损失。

本基金管理人持续健全风险管理制度，完善风险管理信息系统，修订《全面风险管理规定》等制度，推动公募基金压力测试模块、交易所交易行为控制模块测试上线工作，加强对公募基金压力测试及异常交易行为的系统化管理。增强产品投资信用风险的监测预警，揭示相关的信用风险，助力投资部门化解潜在信用风险。加强新产品风险评估，从系统、制度、人员、运作模式、主要风险、应急等方面进行了专项的事前风险评估。组织开展各类压力测试，优化流动性压力测试开放期概率计算方法，完善流动性缺口假设。

(3) 稽核部门对公司业务、内部控制、风险管理等实施独立、客观的监督、评价和建议，完成反洗钱专项稽核等工作。选聘会计师事务所开展原董事长的离任审计。

本报告期，基金管理人认真、严格地履行监察稽核职责，不断完善内部控制的制度体系和组织体系，提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，切实保护基金份额持有人的利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，估值委员会成员由公司总经理、分管投资部门的高级管理人员、公募投资部门负责人、财务负责人、产品部及研究部负责人等人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同（第十六部分基金的收益与分配中三、基金收益分配原则）的约定，报告期

内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，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 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P02263 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“渤海汇金兴荣一年定开基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 8 月 10 日(基金成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了渤海汇金兴荣一年定开基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 8 月 10 日(基金成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于渤海汇金兴荣一年定开基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>渤海汇金证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括渤海汇金兴荣一年定开基金 2021 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p>

	<p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估渤海汇金兴荣一年定开基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算渤海汇金兴荣一年定开基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督渤海汇金兴荣一年定开基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对渤海汇金兴荣一年定开基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致渤海汇金兴荣一年定开基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	曹丽娜 张冠楠
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日

注：会计师出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	416,432.59	-
结算备付金		-	-
存出保证金		0.06	-
交易性金融资产	7.4.7.2	748,181,000.00	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		748,181,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	15,533,112.19	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		764,130,544.84	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		245,312,677.34	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		131,549.28	-
应付托管费		43,849.74	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	28,756.22	-
应交税费		-	-
应付利息		16,210.84	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	79,000.00	-
负债合计		245,612,043.42	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	509,999,500.00	-
未分配利润	7.4.7.10	8,519,001.42	-
所有者权益合计		518,518,501.42	-
负债和所有者权益总计		764,130,544.84	-

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0167 元，基金份额总额 509,999,500.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 8 月 10 日(基 金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		10,329,331.77	-
1. 利息收入		7,282,924.57	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	18,247.93	-
债券利息收入		7,056,088.70	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		208,587.94	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		720,527.20	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	720,527.20	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,325,880.00	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-

减：二、费用		1,810,330.35	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	602,567.67	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	200,855.86	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	13,500.00	-
5. 利息支出		908,895.34	-
其中：卖出回购金融资产支出		908,895.34	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	84,511.48	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,519,001.42	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,519,001.42	-

注：本财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	509,999,500.00	-	509,999,500.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,519,001.42	8,519,001.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	509,999,500.00	8,519,001.42	518,518,501.42

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 10 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>麻众志</u>	<u>边燕萍</u>	<u>刘云鹏</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可〔2020〕3106 号《关于准予渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式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《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式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 509,999,500.00 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 0585 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

509,999,500.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 0.00 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式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良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、政府支持机构债券、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票；也不投资于可转换债券、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前 1 个月、开放期及开放期结束后 1 个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期内每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司于 2022 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 8 月 10 日(基金成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 10 日(基金成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金本报告期内及上年度可比期间内无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、存出保证金、应收利息和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金本报告期内及上年度可比期间内无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款、应付管理人报酬和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发

行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对本基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	416,432.59	-
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	416,432.59	-

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	745,855,120.00	748,181,000.00	2,325,880.00
	合计	745,855,120.00	748,181,000.00	2,325,880.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	745,855,120.00	748,181,000.00	2,325,880.00	
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	49.46	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	15,533,062.73	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	15,533,112.19	-

注：其他包括应收存出保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	28,756.22	-
合计	28,756.22	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	79,000.00	-
合计	79,000.00	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 8 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	509,999,500.00	509,999,500.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	509,999,500.00	509,999,500.00

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金以定期开放式运作，开放期内开放申购或赎回，封闭期内不开放申购或赎回。

7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,193,121.42	2,325,880.00	8,519,001.42
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,193,121.42	2,325,880.00	8,519,001.42

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年8月10日(基金合同生效日)至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	14,183.41	-
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,064.52	-
其他	-	-
合计	18,247.93	-

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

7.4.7.12.3 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。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月10日(基金 合同生效日)至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	720,527.20	-
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	720,527.20	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月10日(基金 合同生效日)至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	627,032,280.12	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	620,974,542.80	-
减：应收利息总额	5,337,210.12	-
买卖债券差价收入	720,527.20	-

7.4.7.13.3 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。

7.4.7.13.4 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。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.14.3 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。

7.4.7.14.4 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。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 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。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年8月10日(基金 合同生效日)至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
1. 交易性金融资产	2,325,880.00	-
——股票投资	-	-
——债券投资	2,325,880.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	2,325,880.00	-

7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月10日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	13,500.00	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	13,500.00	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月10日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	30,000.00	-
信息披露费	40,000.00	-
证券出借违约金	-	-
其他费用	500.00	-
银行汇划费用	2,011.48	-
银行间账户维护费	12,000.00	-
合计	84,511.48	-

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：1、本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年8月10日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	602,567.67	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人渤海汇金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计

至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.3%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年8月10日(基金合同生效日)至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	200,855.86	-

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年8月10日(基金合同	2020年1月1日至2020年12月

	生效日)至 2021 年 12 月 31 日	31 日
基金合同生效日 (2021 年 8 月 10 日) 持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.96%	-

注: 本基金的申购费率适用于所有基金投资人, 赎回费率适用于所有基金份额持有人。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注: 本基金本报告期末及上年度可比期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 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 2021 年 8 月 10 日(基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	416,432.59	14,183.41	-	-

注: 本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管, 按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末 (2021 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金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为人民币 245,312,677.34 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
190409	19 农发 09	2022 年 1 月 4 日	101.54	500,000	50,770,000.00
210303	21 进出 03	2022 年 1 月 4 日	101.25	529,000	53,561,250.00
210406	21 农发 06	2022 年 1 月 4 日	100.40	1,000,000	100,400,000.00
160417	16 农发 17	2022 年 1 月 4 日	101.33	500,000	50,665,000.00
合计				2,529,000	255,396,250.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为一年定期开放发起式债券型基金，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人建立了以董事会为风险管理的最高决策机构，以经营层负责风险管理主体责任，以首席风险官负责风险管理工作具体推动落实，以风险管理委员会为风险管理工作指导机构，由专职的风险控制部门为风险管理的督导执行部门，由管理、支持与保障部门及业务部门、

各分支机构为风险管理的具体落实部门，由稽核部门为风险管理的督导审计部门的多层级的全面风险管理体系。

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	748,181,000.00	-
合计	748,181,000.00	-

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债及政策性金融债券等无债项评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款人民币 245,312,677.34 元将在 1 个月以内到期且计息外，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此未折现的合约到期现金流量为人民币 245,676,886.76 元。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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%。在开放期内，本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 40%；在封闭期内，本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 100%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有流动性受限资产。

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。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金主要投资于交易所以及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 12月 31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	416,432.59	-	-	-	-	416,432.59
存出保证金	0.06	-	-	-	-	0.06
交易	-	-717,412,000.00	30,769,000.00	-	-	-748,181,000.00

金融资产						
应收利息	-	-	-	-15,533,112.19	15,533,112.19	
资产总计	416,432.65	-717,412,000.00	30,769,000.00	15,533,112.19	764,130,544.84	
负债						
卖出回购金融资产款	245,312,677.34	-	-	-	-245,312,677.34	
应付管理人报酬	-	-	-	131,549.28	131,549.28	
应付托管费	-	-	-	43,849.74	43,849.74	
应付交易费用	-	-	-	28,756.22	28,756.22	
应付利息	-	-	-	16,210.84	16,210.84	
其他负债	-	-	-	79,000.00	79,000.00	
负债总计	245,312,677.34	-	-	299,366.08	245,612,043.42	
利率敏感度缺口	-244,896,244.69	-717,412,000.00	30,769,000.00	15,233,746.11	518,518,501.42	
上年度末 2020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						
资产总计	-	-	-	-	-	-

负债					
负债总计	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-4,053,927.11	-
市场利率下降 25 个基点	4,090,898.08		

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所以及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
	-	-	-
	合计	-	-

注：无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中第二层次的余额为人民币 748,181,000.00 元，无属于第一层次及第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具无第三层次余额且无本期变动金额。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	748,181,000.00	97.91
	其中：债券	748,181,000.00	97.91
	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	416,432.59	0.05
8	其他各项资产	15,533,112.25	2.03
9	合计	764,130,544.84	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未持有股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	20,104,000.00	3.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	728,077,000.00	140.41
	其中：政策性金融债	728,077,000.00	140.41
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	748,181,000.00	144.29

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	190305	19 进出 05	1,300,000	131,846,000.00	25.43
2	190203	19 国开 03	1,000,000	101,550,000.00	19.58
3	210406	21 农发 06	1,000,000	100,400,000.00	19.36
4	210303	21 进出 03	600,000	60,750,000.00	11.72
5	190409	19 农发 09	500,000	50,770,000.00	9.79

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

无

8.10.2 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。

8.10.3 本期国债期货投资评价

无

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

无

8.11.2 本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况

无

8.11.3 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	0.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,533,112.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,533,112.25

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2	254,999,750.00	509,999,500.00	100.00%	-	0.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

无

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

注：不涉及，期末无兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理。

9.5 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	10,000,000.00	1.96	10,000,000.00	1.96	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	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	1.96	10,000,000.00	1.96	自合同生效 之日起不少 于三年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年8月10日）基金份额总额	509,999,500.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	509,999,500.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2021 年 3 月 20 日发布公告，自 2021 年 3 月 19 日起，渤海汇金证券资产管理有限公司的副总经理李耀光先生离任。

2、本基金管理人于 2021 年 4 月 22 日发布公告，自 2021 年 4 月 20 日起，齐朝晖先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的代理党总支书记。

3、本基金管理人于 2021 年 8 月 5 日发布公告，自 2021 年 8 月 4 日起，徐海军先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的合规总监，原合规总监刘嫣女士离任。

4、本基金管理人于 2021 年 11 月 23 日发布公告，自 2021 年 11 月 21 日起，边燕萍女士担任渤海汇金证券资产管理有限公司的财务负责人，原财务负责人赵猛先生离任。

5、本基金管理人于 2021 年 11 月 28 日发布公告，自 2021 年 11 月 26 日起，渤海汇金证券资产管理有限公司代理党总支书记齐朝晖先生离任。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金管理人于 2021 年 10 月 27 日发布了《渤海汇金证券资产管理有限公司改聘会计师事务所公告》的公告，自 2021 年 10 月 25 日起，本基金的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。本报告期应支付审计费用 30,000.00 元。截至本报告期末，该审计机构已为本基金提供审计服务 3 个月。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受到稽查或者处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

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

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

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准：券商经营行为规范；具有较强的研究服务能力，包括研究及投资建议质量、报告的及时性及服务质量；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，与其签订协议租用交易单元。

3、截至本报告期末，本公司作为证券公司子公司于 2020 年上半年方获得上海证券交易所租用其他券商交易单元的资格，已逐步按照公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜，后续将按照监管政策要求完善交易单元租用事宜。

4、本基金本报告期内无新增券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
渤海证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	1,002.80	100.00%	509,501,000.00	100.00%	-	-
------	----------	---------	----------------	---------	---	---

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报、公司网站	2021年5月7日
2	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要	上海证券报、公司网站	2021年5月7日
3	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报	2021年5月7日
4	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书	公司网站	2021年5月7日
5	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议	公司网站	2021年5月7日
6	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同	公司网站	2021年5月7日
7	2021年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员(合规总监)变更公告	上海证券报、公司网站	2021年8月5日
8	关于渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	上海证券报、公司网站	2021年8月10日
9	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、公司网站	2021年8月11日

10	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金增聘基金经理公告	上海证券报、公司网站	2021 年 8 月 14 日
11	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）及产品概要（更新）提示性公告	上海证券报	2021 年 8 月 17 日
12	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)（2021 年第 1 号）	公司网站	2021 年 8 月 17 日
13	渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 8 月 17 日
14	关于旗下部分基金增加上海爱建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	上海证券报、公司网站	2021 年 8 月 25 日
15	渤海汇金证券资产管理有限公司改聘会计师事务所公告	上海证券报、公司网站	2021 年 10 月 27 日
16	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（财务负责人）变更公告	上海证券报、公司网站	2021 年 11 月 23 日
17	2021 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	上海证券报、公司网站	2021 年 11 月 28 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20210810-20211231	0.00	499,999,500.00	0.00	499,999,500.00	98.04%
个人	-	-	-	-	-	-	-

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件；

2、《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式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、渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金在指定报刊上的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-5988/400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

渤海汇金证券资产管理有限公司

2022 年 3 月 31 日