

渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                              |           |
|----------------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 8         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 8         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 8         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>10</b> |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 10        |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 10        |
| 3.3 其他指标.....                                | 11        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>12</b> |
| 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.....              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 13        |
| 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.....             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 14        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 15        |
| 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.....       | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 16        |
| 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..... | 16        |
| 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.....      | 16        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 17        |
| 6.2 利润表.....                                 | 18        |

|                                            |           |
|--------------------------------------------|-----------|
| 6.3 净资产（基金净值）变动表.....                      | 19        |
| 6.4 报表附注.....                              | 21        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 43        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                  | 43        |
| 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.....     | 44        |
| 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.....                  | 57        |
| 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.....    | 58        |
| 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..... | 58        |
| 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..... | 58        |
| 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.....    | 58        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                   | 58        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 58        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 58        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>60</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 60        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 60        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 60        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                   | 60        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>61</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>62</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 62        |
| 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.....      | 62        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 62        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 62        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 62        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 62        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 62        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 63        |

---

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....         | <b>65</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 65        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 65        |
| <b>§12 备查文件目录</b> .....                 | <b>66</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 66        |
| 12.2 存放地点.....                          | 66        |
| 12.3 查阅方式.....                          | 66        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                      |
|--------------|----------------------|
| 基金名称         | 渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金 |
| 基金简称         | 渤海汇金量化成长混合           |
| 场内简称         | -                    |
| 基金主代码        | 005536               |
| 基金运作方式       | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日      | 2021 年 12 月 28 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        | 交通银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额   | 43,020,555.84 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 | 本基金通过构建数量化投资策略，重点选择具备高成长潜力的优质上市公司，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 投资策略 | <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金为混合型基金，其股票投资比例占基金资产的比例为 60%-95%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将结合国内外宏观经济走势、财政货币政策、证券市场发展趋势等因素，合理的分配股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>（1）基本面量化策略：深入研究优质成长股具有的财务基本面特征，并将其进行数量化表达，形成基于基本面的量化投资体系。基本面特征包括但不限于估值、营收、盈利、杠杆、周转率等。通过该体系，筛选基本面优秀，或者基本面正在好转的成长股构建投资组合。</p> <p>（2）多因子选股策略：通过对股票历史数据的数量化分析，建立影响股票价格的因子库。通过对各类因子打分构建多因子模型，筛选出收益预期较高的股票组合。本基金使用的因子不仅包括公司盈利能力、成长性、一致预期、估值等基本面类因子，同时也包括股票价格波动相关的各类技术指标，例如价格波动率、成交量、动量趋势、超买超卖等。本基金通过对量化模型中各类因子的持续跟踪来监控因子的有效性，根据市场状况结合因子变化趋势，动态选取最优因子构</p> |

建股票多头组合。

(3) 事件套利选股策略：通过跟踪分析对投资者行为产生一定影响，可造成市场短期价格波动的事件来获取超额投资收益。此类事件包括但不限于定向增发、股东增持、股权激励、业绩公告、资产注入等，相关事件信息要素均由上市公司公告等公开渠道获得。

### (三) 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。

### (四) 股指期货投资策略

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，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

### (五) 国债期货投资策略

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。<br>(六) 资产支持证券投资策略<br>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 | 中证 500 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%                                                                                                                                         |
| 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                         | 交通银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 麻众志                                    | 陆志俊                     |
|         | 联系电话 | 010-68784289                           | 95559                   |
|         | 电子邮箱 | mazz@bhjq.com                          | luzj@bankcomm.com       |
| 客户服务电话  |      | 400-651-5988/<br>400-651-1717          | 95559                   |
| 传真      |      | 022-23861651                           | 021-62701216            |
| 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 | 中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 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 | 中国(上海)长宁区仙霞路 18 号       |
| 邮政编码    |      | 518054                                 | 200336                  |
| 法定代表人   |      | 齐朝晖                                    | 任德奇                     |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                                                               |
|---------------------|---------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报                                                          |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="https://www.bhhjamc.com">https://www.bhhjamc.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所                                                 |

### 2.5 其他相关资料

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





### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,641,716.57                |
| 本期利润          | 5,837,225.83                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1285                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 14.72%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 16.19%                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日)            |
| 期末可供分配利润      | -5,523,066.42               |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1284                     |
| 期末基金资产净值      | 38,908,524.93               |
| 期末基金份额净值      | 0.9044                      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2023年6月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | -9.56%                      |

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。

#### 3.2 基金净值表现

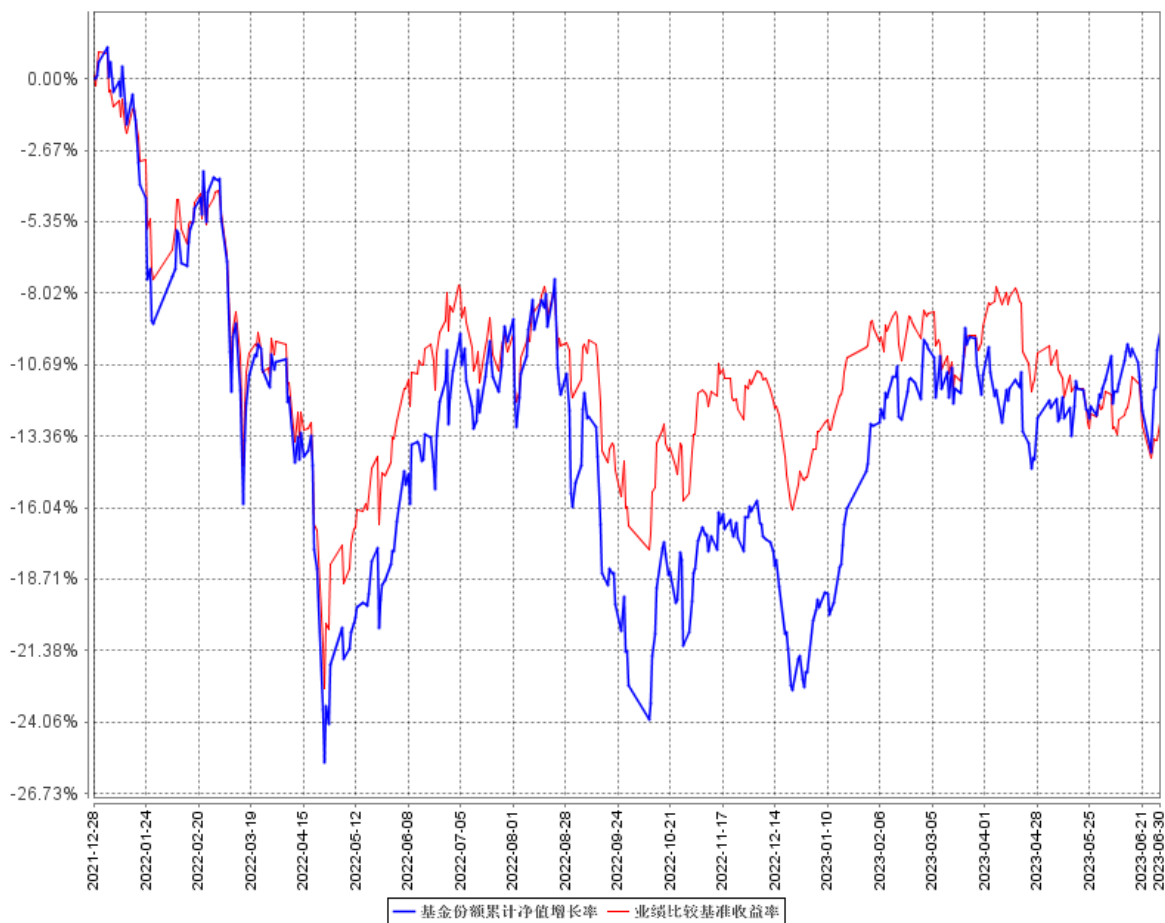
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 2.70%    | 1.10%       | -0.54%     | 0.74%         | 3.24%  | 0.36% |
| 过去三个月      | 1.74%    | 0.94%       | -3.96%     | 0.66%         | 5.70%  | 0.28% |
| 过去六个月      | 16.19%   | 0.92%       | 2.44%      | 0.63%         | 13.75% | 0.29% |
| 过去一年       | 2.68%    | 1.09%       | -4.72%     | 0.77%         | 7.40%  | 0.32% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.56%   | 1.26%       | -12.83%    | 0.97%         | 3.27%  | 0.29% |

注：业绩比较基准：中证500指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%

### 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：本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2023年06月30日，本基金管理人共管理13只公募基金：渤海汇金汇添金货币市场基金、渤海汇金汇增利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金汇添益3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金汇裕87个月定期开放债券型证券投资基金、渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金、渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金、渤海汇金兴宸一年定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金、渤海汇金汇鑫益3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

#### 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 | 本基金的基金经理、公募投资总监、公募投资部总经理 | 2021年12月28日     | -    | 19年    | 南开大学数学学士、金融学硕士。2004年2月至2013年10月就职于渤海证券研究所，任金融工程部经理。2013年10月至2016年8月就职于渤海证券基金管理总部，任投资研究部经理。2016年8月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任公募投资总监。2017年7月至2018年12月担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2018年2月至2022年12月担任渤海汇金睿选混合基金基金 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                              |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 经理。2018 年 7 月至 2022 年 11 月担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。2021 年 3 月起担任渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 28 日起任渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

2、证券从业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。

### 4.2 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《渤海汇金量化成长混合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 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

2023 年上半年，市场需求逐步恢复，国内经济运行整体呈现回升向好态势。但经济修复的过程并非一蹴而就，一季度在积压需求的集中释放下经济呈现一轮快速修复，二季度经济修复斜率放缓，逐渐回归经济内生增长。与此同时，外部环境更趋复杂严峻，美国经济在上半年呈现较强的韧性，美联储鹰派立场程度超出市场预期，地缘摩擦等外围扰动持续不断。上半年，A 股市场伴随着市场预期的变化和调整演绎分化行情。一季度尤其是 1、2 月在强复苏预期及北向资金大幅流入带动下，A 股市场呈现一轮快速修复行情。此后，随着对国内经济增长预期以及美联储降息预期的调整，做多情绪有所回落，市场进入震荡分化。纵观上半年，各宽基指数呈现不同表现，截至 2023 年 6 月 30 日，上半年上证指数、中证 500、中证 1000 指数分别上涨了 3.65%、2.29%、5.1%，而沪深 300、创业板指数则分别下跌了 0.75%、5.61%。行业方面，申万一级行业中通信、传媒、计算机涨幅均在 20%以上，远超其他行业，而商贸零售、房地产、美容护理、建筑材料跌幅在 10%以上。

2023 年上半年，量化成长基金持续把握在资金面宽松、经济温和复苏的环境以及注册制改革的大背景下小市值股票投资机会，力争获取更好的相对中证 500 超额收益。基金以量化小盘选股策略为主，辅以其他量化选股策略积极挖掘优质标的构建组合，在较好把握了小盘股的贝塔收益的同时积极挖掘其中的阿尔法收益，努力为投资者创造更好的投资回报。

### 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 0.9044 元；本报告期基金份额净值增长率为 16.19%，业绩比较基准收益率为 2.44%。

## 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，当前经济运行好转主要是恢复性的，需求仍然不足，内生动力还不强。居民资产负债表修复、企业库存消化和信心恢复还需要时间。国内经济在修复过程中仍可能存在波动。经济转弱背景下逆周期调节政策预期有望再度升温，助力需求复苏、信心修复，需继续关注稳增长政策的节奏和结构。流动性方面，在经济内生增长动能持续企稳前，货币政策尚不具备由松转紧的条件。海外方面，伴随周期下行，货币收紧及信用收缩影响的持续深化，下半年美国经济增长压力将有所加大，但在超额储蓄的支撑下短期仍可能保持较高韧性，美联储降息开启时间或将后移。当前市场估值仍具备一定优势，悲观情绪得到一定释放，但国内经济恢复基础尚不稳固，海外市场仍存在不确定性，在流动偏宽松的环境下下半年市场或将延续结构性行情，小市值风格仍将呈现较好的贝塔收益。尤其在全面注册制的背景下，A 股数量的大幅增多加剧了小市值风格

的弱有效性，从而带来小市值风格的长期阿尔法收益机会。因此，在当前以及未来较长时间内，我们仍然持续看好小盘风格的表现，本基金将继续围绕小盘风格进行量化策略的优化，努力提升基金的净值表现。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

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

本报告期内，基金托管人在渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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，渤海汇金证券资产管理有限公司在渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由渤海汇金证券资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 2,367,397.28                   | 2,919,939.66                     |
| 结算备付金         |            | 4,602.48                       | 1,958,535.29                     |
| 存出保证金         |            | -                              | 397,249.20                       |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 36,749,869.40                  | 31,871,110.09                    |
| 其中：股票投资       |            | 36,749,869.40                  | 31,783,527.00                    |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | -                              | 87,583.09                        |
| 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    | -                              | -                                |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 786.46                         | 299.64                           |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 39,122,655.62                  | 37,147,133.88                    |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2022 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                                |                                  |
| 短期借款          |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                              | -                                |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |

|             |          |               |                |
|-------------|----------|---------------|----------------|
| 应付赎回款       |          | 135,164.36    | 1,458.84       |
| 应付管理人报酬     |          | 37,921.35     | 39,286.95      |
| 应付托管费       |          | 6,320.22      | 6,547.81       |
| 应付销售服务费     |          | -             | -              |
| 应付投资顾问费     |          | -             | -              |
| 应交税费        |          | -             | 0.35           |
| 应付利润        |          | -             | -              |
| 递延所得税负债     |          | -             | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 34,724.76     | 140,000.00     |
| 负债合计        |          | 214,130.69    | 187,293.95     |
| <b>净资产：</b> |          |               |                |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 43,020,555.84 | 47,481,383.36  |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -             | -              |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | -4,112,030.91 | -10,521,543.43 |
| 净资产合计       |          | 38,908,524.93 | 36,959,839.93  |
| 负债和净资产总计    |          | 39,122,655.62 | 37,147,133.88  |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9044 元，基金份额总额 43,020,555.84 份。

## 6.2 利润表

会计主体：渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至<br>2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | 6,147,048.97                             | -7,584,093.01                                 |
| 1.利息收入           |          | 5,530.52                                 | 32,110.86                                     |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.13 | 5,530.52                                 | 7,823.42                                      |
| 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       |          | -                                        | 24,287.44                                     |
| 证券出借利息收入         |          | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入           |          | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 2,942,959.25                             | -10,942,186.94                                |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.14 | 2,549,283.61                             | -11,373,144.86                                |
| 基金投资收益           |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益           | 6.4.7.15 | 11,743.64                                | -                                             |
| 资产支持证券投资收益       | 6.4.7.16 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益          | 6.4.7.17 | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益           | 6.4.7.18 | 59,860.71                                | 19,769.51                                     |
| 股利收益             | 6.4.7.19 | 322,071.29                               | 411,188.41                                    |
| 以摊余成本计量的金融资      |          | -                                        | -                                             |

|                            |            |              |               |
|----------------------------|------------|--------------|---------------|
| 产终止确认产生的收益                 |            |              |               |
| 其他投资收益                     |            | -            | -             |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.20   | 3,195,509.26 | 3,309,654.29  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -            | -             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.21   | 3,049.94     | 16,328.78     |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 309,823.14   | 430,680.75    |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 235,620.33   | 309,243.79    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 39,270.02    | 51,540.60     |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -            | -             |
| 4. 投资顾问费                   |            | -            | -             |
| 5. 利息支出                    |            | -            | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -            | -             |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | -            | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | 220.61       | 72.00         |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 34,712.18    | 69,824.36     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 5,837,225.83 | -8,014,773.76 |
| 减：所得税费用                    |            | -            | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 5,837,225.83 | -8,014,773.76 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -            | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 5,837,225.83 | -8,014,773.76 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |        |                |               |
|-----------------|---------------------------------------|--------|----------------|---------------|
|                 | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 47,481,383.36                         | -      | -10,521,543.43 | 36,959,839.93 |
| 加：会计政策变更        | -                                     | -      | -              | -             |
| 前期差错更正          | -                                     | -      | -              | -             |
| 其他              | -                                     | -      | -              | -             |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 47,481,383.36                         | -      | -10,521,543.43 | 36,959,839.93 |

|                                          |                                            |        |               |                |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|---------------|----------------|
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                 | -4,460,827.52                              | -      | 6,409,512.52  | 1,948,685.00   |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 5,837,225.83  | 5,837,225.83   |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -4,460,827.52                              | -      | 572,286.69    | -3,888,540.83  |
| 其中：1.基金申购款                               | 1,357,681.59                               | -      | -163,450.05   | 1,194,231.54   |
| 2.基金赎回款                                  | -5,818,509.11                              | -      | 735,736.74    | -5,082,772.37  |
| (三)、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) | -                                          | -      | -             | -              |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                          | -      | -             | -              |
| 四、本期期末净资产<br>(基金净值)                      | 43,020,555.84                              | -      | -4,112,030.91 | 38,908,524.93  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |               |                |
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产<br>(基金净值)                      | 61,098,365.18                              | -      | 397,842.35    | 61,496,207.53  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -                                          | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产<br>(基金净值)                      | 61,098,365.18                              | -      | 397,842.35    | 61,496,207.53  |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                 | -7,847,516.61                              | -      | -6,742,899.61 | -14,590,416.22 |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | -8,014,773.76 | -8,014,773.76  |
| (二)、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)      | -7,847,516.61                              | -      | 1,271,874.15  | -6,575,642.46  |
| 其中：1.基金申购款                               | 98,325.30                                  | -      | -16,072.97    | 82,252.33      |



债、公开发行的次级债、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。本基金业绩比较基准:中证 500 指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值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 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]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

进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人作为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2023 年 6 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           | 2,367,397.28           |
| 等于：本金          | 2,367,112.61           |
| 加：应计利息         | 284.67                 |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计：            | 2,367,397.28           |

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

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |      |               |              |
|---------------|------------------------|------|---------------|--------------|
|               | 成本                     | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            | 35,196,597.24          | -    | 36,749,869.40 | 1,553,272.16 |
| 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            | 35,196,597.24          | -    | 36,749,869.40 | 1,553,272.16 |

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。



#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 12.58             |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | -                 |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | -                 |
| -           | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 34,712.18         |
| 合计          | 34,724.76         |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |               |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额          |
| 上年度末          | 47,481,383.36                         | 47,481,383.36 |
| 本期申购          | 1,357,681.59                          | 1,357,681.59  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -5,818,509.11                         | -5,818,509.11 |
| - 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           | 43,020,555.84                         | 43,020,555.84 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 6.4.7.12 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        |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 本期期初           | -8,784,540.55 | -1,737,002.88 | -10,521,543.43 |
| 本期利润           | 2,641,716.57  | 3,195,509.26  | 5,837,225.83   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 619,757.56    | -47,470.87    | 572,286.69     |
| 其中：基金申购款       | -183,452.31   | 20,002.26     | -163,450.05    |
| 基金赎回款          | 803,209.87    | -67,473.13    | 735,736.74     |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -              |
| 本期末            | -5,523,066.42 | 1,411,035.51  | -4,112,030.91  |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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 | 5,530.52                              |

|           |          |
|-----------|----------|
| 结算备付金利息收入 | -        |
| 其他        | -        |
| 合计        | 5,530.52 |

注：其他存款利息收入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产生的利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 2,549,283.61               |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                          |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                          |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                          |
| 合计               | 2,549,283.61               |

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 126,788,642.17             |
| 减：卖出股票成本总额 | 123,910,531.89             |
| 减：交易费用     | 328,826.67                 |
| 买卖股票差价收入   | 2,549,283.61               |

##### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                  | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入        | 35.37                      |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债 | 11,708.27                  |

|                |           |
|----------------|-----------|
| 券到期兑付) 差价收入    |           |
| 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             | 11,743.64 |

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                   |
|-------------------------|----------------------|
|                         | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 88,784.15            |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 77,000.00            |
| 减：应计利息总额                | 70.54                |
| 减：交易费用                  | 5.34                 |
| 买卖债券差价收入                | 11,708.27            |

#### 6.4.7.15.3 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。

#### 6.4.7.15.4 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。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 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。

##### 6.4.7.16.2 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。

##### 6.4.7.16.3 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。

##### 6.4.7.16.4 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。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 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。

**6.4.7.17.2 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。

**6.4.7.17.3 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。

**6.4.7.17.4 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。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 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。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

| 项目       | 本期收益金额<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------|--------------------------------|
| 国债期货投资收益 | -                              |
| 股指期货投资收益 | 59,922.72                      |

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 322,071.29                 |
| 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            | 322,071.29                 |

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------|----|
|------|----|

|                            | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 3,115,389.26                    |
| ——股票投资                     | 3,125,938.26                    |
| ——债券投资                     | -10,549.00                      |
| ——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                      | 80,120.00                       |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -                               |
| 合计                         | 3,195,509.26                    |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 3,049.94                              |
| 合计      | 3,049.94                              |

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 9,916.99                              |
| 信息披露费   | 24,795.19                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 其他费用    | -                                     |
| 合计      | 34,712.18                             |

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告报出日，本基金无需说明的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期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。

### 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       |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）       | 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、基金销售机构、基金证券经纪商 |

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。

## 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 渤海证券  | 252,539,578.20             | 100.00%          | 505,893,197.30                  | 100.00%          |

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-------|----------------------------|---------------------------------|
|-------|----------------------------|---------------------------------|

|      | 成交金额      | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
|------|-----------|------------------|------|------------------|
| 渤海证券 | 88,784.15 | 100.00%          | -    | -                |

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                    | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                        |
|-------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|------------------------|
|       | 回购成交金额                     | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 | 回购成交金额                          | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的比例 |
| 渤海证券  | -                          | -                  | 133,500,000.00                  | 100.00%                |

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日      |                |          |                  |
|-------|---------------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期佣金                            | 占当期佣金总量<br>的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 渤海证券  | 182,151.98                      | 100.00%        | -        | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                |          |                  |
|       | 当期佣金                            | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 渤海证券  | 361,021.62                      | 100.00%        | -        | -                |

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----|--------------------------------|---------------------------------|
|    |                                |                                 |



|                 |            |            |
|-----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 235,620.33 | 309,243.79 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 88,578.72  | 124,603.12 |

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 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2023年1月1日至2023年6月30日 | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 39,270.02            | 51,540.60            |

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生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。

##### 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。

#### 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

份额单位：份

| 项目                               | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                                  | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日（2021 年 12 月 28 日）持有的基金份额 | -                               | -                               |
| 报告期初持有的基金份额                      | 10,000,527.83                   | 10,000,527.83                   |
| 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                      | 10,000,527.83                   | 10,000,527.83                   |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例              | 23.25%                          | 18.78%                          |

注：基金管理人投资本基金适用的认（申）购/赎回费按本基金基金合同和招募说明书规定执行。

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

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                              |          | 上年度可比期间                         |          |
|-------|---------------------------------|----------|---------------------------------|----------|
|       | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |          | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |          |
|       | 期末余额                            | 当期利息收入   | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 交通银行  | -                               | -        | -                               | -        |
| 渤海证券  | 2,367,397.28                    | 5,530.52 | 3,376,902.93                    | 7,823.42 |

注：1、本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金的其他存款为本基金存放于渤海证券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在承销期内参与关联方承销的证券。

##### 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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关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。

#### 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主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

**6.4.13.2.4 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<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                      | -                        |
| AAA 以下 | -                      | 87,583.09                |
| 未评级    | -                      | -                        |
| 合计     | -                      | 87,583.09                |

注：上述评级取自第三方评级机构的债项评级。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

**6.4.13.3 流动性风险**

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

**6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

#### 6.4.13.3.2 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%。本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人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。

#### 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。

本基金本期未投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此未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<br>2023年6月30日   | 6个月以内        | 6个月-1<br>年 | 1-5年 | 5年以上      | 不计息            | 合计            |
|---------------------|--------------|------------|------|-----------|----------------|---------------|
| 资产                  |              |            |      |           |                |               |
| 结算备付金               | 2,371,999.76 | -          | -    | -         | -              | 2,371,999.76  |
| 交易性金融资产             | -            | -          | -    | -         | 36,749,869.40  | 36,749,869.40 |
| 应收申购款               | -            | -          | -    | -         | 786.46         | 786.46        |
| 资产总计                | 2,371,999.76 | -          | -    | -         | 36,750,655.86  | 39,122,655.62 |
| 负债                  |              |            |      |           |                |               |
| 应付赎回款               | -            | -          | -    | -         | 135,164.36     | 135,164.36    |
| 应付管理人报酬             | -            | -          | -    | -         | 37,921.35      | 37,921.35     |
| 应付托管费               | -            | -          | -    | -         | 6,320.22       | 6,320.22      |
| 其他负债                | -            | -          | -    | -         | 34,724.76      | 34,724.76     |
| 负债总计                | -            | -          | -    | -         | 214,130.69     | 214,130.69    |
| 利率敏感度缺口             | 2,371,999.76 | -          | -    | -         | -36,536,525.17 | 38,908,524.93 |
| 上年度末<br>2022年12月31日 | 6个月以内        | 6个月-1<br>年 | 1-5年 | 5年以上      | 不计息            | 合计            |
| 资产                  |              |            |      |           |                |               |
| 结算备付金               | 1,958,535.29 | -          | -    | -         | -              | 1,958,535.29  |
| 存出保证金               | 397,249.20   | -          | -    | -         | -              | 397,249.20    |
| 银行存款                | 2,919,560.47 | -          | -    | -         | 379.19         | 2,919,939.66  |
| 交易性金融资产             | -            | -          | -    | 87,549.00 | 31,783,561.09  | 31,871,110.09 |
| 应收清算款               | -            | -          | -    | -         | -              | -             |

|         |              |   |           |               |               |
|---------|--------------|---|-----------|---------------|---------------|
| 应收申购款   | -            | - | -         | 299.64        | 299.64        |
| 其他资产    | -            | - | -         | -             | -             |
| 资产总计    | 5,275,344.96 | - | 87,549.00 | 31,784,239.92 | 37,147,133.88 |
| 负债      | -            | - | -         | -             | -             |
| 应付赎回款   | -            | - | -         | 1,458.84      | 1,458.84      |
| 应付管理人报酬 | -            | - | -         | 39,286.95     | 39,286.95     |
| 应付托管费   | -            | - | -         | 6,547.81      | 6,547.81      |
| 应交税费    | -            | - | -         | 0.35          | 0.35          |
| 其他负债    | -            | - | -         | 140,000.00    | 140,000.00    |
| 负债总计    | -            | - | -         | 187,293.95    | 187,293.95    |
| 利率敏感度缺口 | 5,275,344.96 | - | 87,549.00 | 31,596,945.97 | 36,959,839.93 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：无。

#### 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 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|



|               | 2023 年 6 月 30 日 |               | 2022 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  | 36,749,869.40   | 94.45         | 31,783,527.00    | 85.99         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -               | -             | -                | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | -               | -             | -                | -             |
| 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            | 36,749,869.40   | 94.45         | 31,783,527.00    | 85.99         |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设             | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----------------|----------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析             | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|                |                      | 本期末（2023 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|                | 1. 业绩比较基准上升 5%       | 1,763,225.33                | 1,301,712.09           |
| 2. 业绩比较基准下降 5% | -1,763,225.33        | -1,301,712.09               |                        |

#### 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。 |               |                      |                        |
|------------------------------|---------------|----------------------|------------------------|
| 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（2023 年 6 月 30 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|                              | -             | -                    | -                      |
|                              | 合计            | -                    | -                      |

注：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<br>2023年6月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 36,749,869.40     | 31,783,527.00       |
| 第二层次          | -                 | 87,583.09           |
| 第三层次          | -                 | -                   |
| 合计            | 36,749,869.40     | 31,871,110.09       |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 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。

##### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

## § 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              | 36,749,869.40 | 93.94         |
|    | 其中：股票             | 36,749,869.40 | 93.94         |
| 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      | 2,371,999.76  | 6.06          |
| 8  | 其他各项资产            | 786.46        | 0.00          |
| 9  | 合计                | 39,122,655.62 | 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

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值 (元)      | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 325,092.00    | 0.84          |
| C  | 制造业              | 27,999,612.40 | 71.96         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,021,347.00  | 2.62          |
| E  | 建筑业              | 1,224,784.00  | 3.15          |
| F  | 批发和零售业           | 1,541,813.00  | 3.96          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 303,520.00    | 0.78          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,737,181.00  | 7.03          |
| J  | 金融业              | 597,248.00    | 1.54          |
| K  | 房地产业             | 635,584.00    | 1.63          |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 173,088.00    | 0.44          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -             |

|   |           |               |       |
|---|-----------|---------------|-------|
| P | 教育        | 190,600.00    | 0.49  |
| Q | 卫生和社会工作   | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业 | -             | -     |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 36,749,869.40 | 94.45 |

### 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  | 000521 | 长虹美菱 | 101,700 | 776,988.00 | 2.00         |
| 2  | 600060 | 海信视像 | 30,000  | 742,500.00 | 1.91         |
| 3  | 301106 | 骏成科技 | 20,000  | 712,400.00 | 1.83         |
| 4  | 002387 | 维信诺  | 77,300  | 708,841.00 | 1.82         |
| 5  | 002290 | 禾盛新材 | 52,000  | 694,200.00 | 1.78         |
| 6  | 300097 | 智云股份 | 100,800 | 674,352.00 | 1.73         |
| 7  | 002381 | 双箭股份 | 87,100  | 672,412.00 | 1.73         |
| 8  | 002448 | 中原内配 | 95,200  | 666,400.00 | 1.71         |
| 9  | 688566 | 吉贝尔  | 16,500  | 643,665.00 | 1.65         |
| 10 | 301051 | 信濠光电 | 10,600  | 641,194.00 | 1.65         |
| 11 | 603499 | 翔港科技 | 67,000  | 639,180.00 | 1.64         |
| 12 | 300644 | 南京聚隆 | 34,000  | 631,720.00 | 1.62         |
| 13 | 688360 | 德马科技 | 28,000  | 621,320.00 | 1.60         |
| 14 | 002743 | 富煌钢构 | 107,200 | 616,400.00 | 1.58         |
| 15 | 002809 | 红墙股份 | 57,000  | 615,600.00 | 1.58         |
| 16 | 300270 | 中威电子 | 80,000  | 612,000.00 | 1.57         |
| 17 | 300926 | 博俊科技 | 26,000  | 593,840.00 | 1.53         |
| 18 | 300132 | 青松股份 | 102,300 | 580,041.00 | 1.49         |
| 19 | 600469 | 风神股份 | 90,000  | 579,600.00 | 1.49         |
| 20 | 603725 | 天安新材 | 70,500  | 573,165.00 | 1.47         |
| 21 | 002718 | 友邦吊顶 | 33,700  | 510,892.00 | 1.31         |
| 22 | 600863 | 内蒙华电 | 120,000 | 498,000.00 | 1.28         |
| 23 | 002919 | 名臣健康 | 10,270  | 463,177.00 | 1.19         |
| 24 | 300823 | 建科机械 | 22,000  | 452,100.00 | 1.16         |
| 25 | 002322 | 理工能科 | 38,000  | 395,200.00 | 1.02         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 26 | 002893 | 京能热力 | 36,100  | 388,797.00 | 1.00 |
| 27 | 603758 | 秦安股份 | 36,400  | 387,296.00 | 1.00 |
| 28 | 300753 | 爱朋医疗 | 21,100  | 386,763.00 | 0.99 |
| 29 | 000599 | 青岛双星 | 89,200  | 380,884.00 | 0.98 |
| 30 | 600686 | 金龙汽车 | 45,400  | 369,556.00 | 0.95 |
| 31 | 300698 | 万马科技 | 13,000  | 369,070.00 | 0.95 |
| 32 | 300462 | 华铭智能 | 31,400  | 368,636.00 | 0.95 |
| 33 | 002899 | 英派斯  | 24,500  | 366,765.00 | 0.94 |
| 34 | 000404 | 长虹华意 | 51,400  | 355,688.00 | 0.91 |
| 35 | 603803 | 瑞斯康达 | 37,600  | 354,192.00 | 0.91 |
| 36 | 600791 | 京能置业 | 77,100  | 353,889.00 | 0.91 |
| 37 | 002694 | 顾地科技 | 55,400  | 351,236.00 | 0.90 |
| 38 | 300467 | 迅游科技 | 17,100  | 349,353.00 | 0.90 |
| 39 | 300329 | 海伦钢琴 | 48,500  | 342,895.00 | 0.88 |
| 40 | 000717 | 中南股份 | 119,300 | 331,654.00 | 0.85 |
| 41 | 600082 | 海泰发展 | 104,200 | 328,230.00 | 0.84 |
| 42 | 600287 | 江苏舜天 | 63,800  | 326,018.00 | 0.84 |
| 43 | 600892 | 大晟文化 | 49,300  | 325,873.00 | 0.84 |
| 44 | 603556 | 海兴电力 | 12,900  | 325,596.00 | 0.84 |
| 45 | 000680 | 山推股份 | 57,000  | 320,910.00 | 0.82 |
| 46 | 300464 | 星徽股份 | 47,600  | 317,492.00 | 0.82 |
| 47 | 300420 | 五洋停车 | 96,400  | 316,192.00 | 0.81 |
| 48 | 000705 | 浙江震元 | 39,200  | 315,560.00 | 0.81 |
| 49 | 002970 | 锐明技术 | 9,700   | 305,453.00 | 0.79 |
| 50 | 600908 | 无锡银行 | 56,500  | 302,840.00 | 0.78 |
| 51 | 002775 | 文科园林 | 79,400  | 297,750.00 | 0.77 |
| 52 | 002839 | 张家港行 | 69,600  | 294,408.00 | 0.76 |
| 53 | 603161 | 科华控股 | 20,000  | 291,400.00 | 0.75 |
| 54 | 002533 | 金杯电工 | 35,300  | 288,048.00 | 0.74 |
| 55 | 002652 | 扬子新材 | 108,700 | 286,968.00 | 0.74 |
| 56 | 002822 | 中装建设 | 69,300  | 286,902.00 | 0.74 |
| 57 | 300749 | 顶固集创 | 30,700  | 282,133.00 | 0.73 |
| 58 | 002789 | 建艺集团 | 19,400  | 281,882.00 | 0.72 |
| 59 | 600067 | 冠城大通 | 106,300 | 281,695.00 | 0.72 |
| 60 | 600498 | 烽火通信 | 13,800  | 281,106.00 | 0.72 |
| 61 | 300242 | 佳云科技 | 80,000  | 276,000.00 | 0.71 |
| 62 | 300127 | 银河磁体 | 15,200  | 275,576.00 | 0.71 |
| 63 | 603551 | 奥普家居 | 21,000  | 271,530.00 | 0.70 |
| 64 | 603166 | 福达股份 | 40,200  | 270,948.00 | 0.70 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 65  | 603328 | 依顿电子 | 32,100 | 265,788.00 | 0.68 |
| 66  | 300419 | 浩丰科技 | 42,200 | 264,172.00 | 0.68 |
| 67  | 605259 | 绿田机械 | 6,800  | 263,976.00 | 0.68 |
| 68  | 300157 | 恒泰艾普 | 81,600 | 262,752.00 | 0.68 |
| 69  | 300625 | 三雄极光 | 20,900 | 261,250.00 | 0.67 |
| 70  | 603368 | 柳药集团 | 10,300 | 254,513.00 | 0.65 |
| 71  | 001218 | 丽臣实业 | 11,100 | 250,971.00 | 0.65 |
| 72  | 300554 | 三超新材 | 12,000 | 249,960.00 | 0.64 |
| 73  | 300449 | 汉邦高科 | 37,000 | 246,790.00 | 0.63 |
| 74  | 002062 | 宏润建设 | 45,000 | 243,450.00 | 0.63 |
| 75  | 600973 | 宝胜股份 | 50,000 | 242,500.00 | 0.62 |
| 76  | 300378 | 鼎捷软件 | 7,000  | 239,750.00 | 0.62 |
| 77  | 600285 | 羚锐制药 | 14,700 | 236,082.00 | 0.61 |
| 78  | 600377 | 宁沪高速 | 24,000 | 235,920.00 | 0.61 |
| 79  | 300701 | 森霸传感 | 21,000 | 229,530.00 | 0.59 |
| 80  | 002572 | 索菲亚  | 13,000 | 226,460.00 | 0.58 |
| 81  | 603639 | 海利尔  | 12,500 | 224,000.00 | 0.58 |
| 82  | 603609 | 禾丰股份 | 24,200 | 220,220.00 | 0.57 |
| 83  | 601003 | 柳钢股份 | 50,000 | 202,000.00 | 0.52 |
| 84  | 300597 | 吉大通信 | 20,000 | 198,200.00 | 0.51 |
| 85  | 002746 | 仙坛股份 | 25,000 | 197,000.00 | 0.51 |
| 86  | 300552 | 万集科技 | 10,000 | 194,600.00 | 0.50 |
| 87  | 600661 | 昂立教育 | 20,000 | 190,600.00 | 0.49 |
| 88  | 600089 | 特变电工 | 8,000  | 178,320.00 | 0.46 |
| 89  | 300422 | 博世科  | 28,800 | 173,088.00 | 0.44 |
| 90  | 002351 | 漫步者  | 8,000  | 165,440.00 | 0.43 |
| 91  | 300822 | 贝仕达克 | 12,000 | 163,680.00 | 0.42 |
| 92  | 002583 | 海能达  | 27,000 | 156,870.00 | 0.40 |
| 93  | 002737 | 葵花药业 | 6,400  | 155,776.00 | 0.40 |
| 94  | 300907 | 康平科技 | 7,000  | 150,290.00 | 0.39 |
| 95  | 600448 | 华纺股份 | 50,000 | 148,500.00 | 0.38 |
| 96  | 600780 | 通宝能源 | 13,000 | 134,550.00 | 0.35 |
| 97  | 603045 | 福达合金 | 8,000  | 121,120.00 | 0.31 |
| 98  | 603035 | 常熟汽饰 | 6,000  | 116,580.00 | 0.30 |
| 99  | 601668 | 中国建筑 | 20,000 | 114,800.00 | 0.30 |
| 100 | 600114 | 东睦股份 | 15,000 | 114,300.00 | 0.29 |
| 101 | 600602 | 云赛智联 | 7,000  | 105,420.00 | 0.27 |
| 102 | 300787 | 海能实业 | 5,000  | 98,500.00  | 0.25 |
| 103 | 603920 | 世运电路 | 5,000  | 97,650.00  | 0.25 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 104 | 000048 | 京基智农 | 5,000  | 97,600.00 | 0.25 |
| 105 | 002979 | 雷赛智能 | 4,000  | 95,040.00 | 0.24 |
| 106 | 300407 | 凯发电气 | 10,000 | 91,300.00 | 0.23 |
| 107 | 603968 | 醋化股份 | 5,000  | 88,800.00 | 0.23 |
| 108 | 300188 | 美亚柏科 | 4,000  | 83,160.00 | 0.21 |
| 109 | 301083 | 百胜智能 | 3,500  | 81,900.00 | 0.21 |
| 110 | 688081 | 兴图新科 | 4,000  | 76,680.00 | 0.20 |
| 111 | 688335 | 复洁环保 | 3,000  | 73,620.00 | 0.19 |
| 112 | 601326 | 秦港股份 | 20,000 | 67,600.00 | 0.17 |
| 113 | 300936 | 中英科技 | 2,000  | 67,480.00 | 0.17 |
| 114 | 688517 | 金冠电气 | 3,000  | 65,880.00 | 0.17 |
| 115 | 603109 | 神驰机电 | 3,500  | 62,475.00 | 0.16 |
| 116 | 605086 | 龙高股份 | 3,000  | 62,340.00 | 0.16 |
| 117 | 600761 | 安徽合力 | 3,000  | 59,790.00 | 0.15 |
| 118 | 688063 | 派能科技 | 200    | 39,650.00 | 0.10 |
| 119 | 002849 | 威星智能 | 2,000  | 37,280.00 | 0.10 |
| 120 | 688096 | 京源环保 | 3,360  | 33,062.40 | 0.08 |
| 121 | 600213 | 亚星客车 | 3,000  | 30,810.00 | 0.08 |
| 122 | 002020 | 京新药业 | 1,000  | 12,820.00 | 0.03 |
| 123 | 300725 | 药石科技 | 100    | 4,843.00  | 0.01 |

## 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  | 603499 | 翔港科技 | 1,214,616.00 | 3.29           |
| 2  | 000521 | 长虹美菱 | 1,184,506.00 | 3.20           |
| 3  | 600863 | 内蒙华电 | 1,158,590.00 | 3.13           |
| 4  | 300597 | 吉大通信 | 1,083,700.00 | 2.93           |
| 5  | 600060 | 海信视像 | 1,020,168.00 | 2.76           |
| 6  | 301106 | 骏成科技 | 995,886.00   | 2.69           |
| 7  | 300378 | 鼎捷软件 | 952,929.00   | 2.58           |
| 8  | 688566 | 吉贝尔  | 946,787.05   | 2.56           |
| 9  | 603725 | 天安新材 | 939,680.00   | 2.54           |
| 10 | 603536 | 惠发食品 | 934,511.00   | 2.53           |
| 11 | 603828 | 柯利达  | 917,741.00   | 2.48           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 12 | 300132 | 青松股份 | 911,370.00 | 2.47 |
| 13 | 002290 | 禾盛新材 | 897,333.00 | 2.43 |
| 14 | 300097 | 智云股份 | 876,188.00 | 2.37 |
| 15 | 688335 | 复洁环保 | 814,140.00 | 2.20 |
| 16 | 600469 | 风神股份 | 791,641.00 | 2.14 |
| 17 | 600421 | 华嵘控股 | 774,796.00 | 2.10 |
| 18 | 603035 | 常熟汽饰 | 772,471.00 | 2.09 |
| 19 | 688260 | 昀冢科技 | 772,349.00 | 2.09 |
| 20 | 300701 | 森霸传感 | 739,911.46 | 2.00 |

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  | 603083 | 剑桥科技   | 1,233,176.00 | 3.34           |
| 2  | 603536 | 惠发食品   | 1,191,733.00 | 3.22           |
| 3  | 603828 | 柯利达    | 1,189,628.00 | 3.22           |
| 4  | 300311 | 任子行    | 1,034,946.00 | 2.80           |
| 5  | 600421 | 华嵘控股   | 953,932.00   | 2.58           |
| 6  | 688229 | 博睿数据   | 927,417.20   | 2.51           |
| 7  | 002066 | 瑞泰科技   | 905,693.00   | 2.45           |
| 8  | 300597 | 吉大通信   | 901,355.00   | 2.44           |
| 9  | 600761 | 安徽合力   | 889,290.00   | 2.41           |
| 10 | 000921 | 海信家电   | 829,584.00   | 2.24           |
| 11 | 603030 | *ST 全筑 | 753,180.00   | 2.04           |
| 12 | 300567 | 精测电子   | 743,883.00   | 2.01           |
| 13 | 600863 | 内蒙华电   | 728,900.00   | 1.97           |
| 14 | 603725 | 天安新材   | 703,280.00   | 1.90           |
| 15 | 688335 | 复洁环保   | 689,461.58   | 1.87           |
| 16 | 300378 | 鼎捷软件   | 684,168.00   | 1.85           |
| 17 | 603269 | 海鸥股份   | 673,520.00   | 1.82           |
| 18 | 688260 | 昀冢科技   | 667,584.24   | 1.81           |
| 19 | 002017 | 东信和平   | 664,328.00   | 1.80           |
| 20 | 600356 | 恒丰纸业   | 656,229.00   | 1.78           |
| 21 | 002963 | 豪尔赛    | 654,229.00   | 1.77           |



|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 22 | 300445 | 康斯特  | 652,908.00 | 1.77 |
| 23 | 600960 | 渤海汽车 | 648,439.00 | 1.75 |
| 24 | 300135 | 宝利国际 | 646,121.00 | 1.75 |
| 25 | 600469 | 风神股份 | 646,076.00 | 1.75 |
| 26 | 002719 | 麦趣尔  | 644,584.00 | 1.74 |
| 27 | 603499 | 翔港科技 | 641,095.00 | 1.73 |
| 28 | 603059 | 倍加洁  | 638,745.00 | 1.73 |
| 29 | 000533 | 顺钠股份 | 636,043.00 | 1.72 |
| 30 | 603035 | 常熟汽饰 | 630,782.74 | 1.71 |
| 31 | 002133 | 广宇集团 | 628,553.00 | 1.70 |
| 32 | 000417 | 合肥百货 | 626,814.00 | 1.70 |
| 33 | 300100 | 双林股份 | 625,947.00 | 1.69 |
| 34 | 300645 | 正元智慧 | 624,664.00 | 1.69 |
| 35 | 300175 | 朗源股份 | 622,904.00 | 1.69 |
| 36 | 002116 | 中国海诚 | 619,053.00 | 1.67 |
| 37 | 600629 | 华建集团 | 613,928.00 | 1.66 |
| 38 | 002126 | 银轮股份 | 613,034.00 | 1.66 |
| 39 | 300321 | 同大股份 | 611,871.00 | 1.66 |
| 40 | 300931 | 通用电梯 | 611,755.00 | 1.66 |
| 41 | 600619 | 海立股份 | 610,480.00 | 1.65 |
| 42 | 300899 | 上海凯鑫 | 610,207.00 | 1.65 |
| 43 | 600538 | 国发股份 | 608,799.00 | 1.65 |
| 44 | 002865 | 钧达股份 | 607,092.48 | 1.64 |
| 45 | 688668 | 鼎通科技 | 604,601.61 | 1.64 |
| 46 | 603268 | 松发股份 | 604,035.00 | 1.63 |
| 47 | 300129 | 泰胜风能 | 602,220.00 | 1.63 |
| 48 | 688138 | 清溢光电 | 601,294.24 | 1.63 |
| 49 | 000521 | 长虹美菱 | 598,024.00 | 1.62 |
| 50 | 600210 | 紫江企业 | 597,906.00 | 1.62 |
| 51 | 603813 | 原尚股份 | 595,111.00 | 1.61 |
| 52 | 600883 | 博闻科技 | 593,364.00 | 1.61 |
| 53 | 603038 | 华立股份 | 592,681.00 | 1.60 |
| 54 | 002136 | 安纳达  | 591,811.00 | 1.60 |
| 55 | 300169 | 天晟新材 | 591,370.00 | 1.60 |
| 56 | 300391 | 长药控股 | 590,762.00 | 1.60 |
| 57 | 000679 | 大连友谊 | 588,523.00 | 1.59 |
| 58 | 603159 | 上海亚虹 | 584,573.00 | 1.58 |
| 59 | 300689 | 澄天伟业 | 581,873.00 | 1.57 |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 60 | 002856 | 美芝股份 | 580,030.00 | 1.57 |
| 61 | 002663 | 普邦股份 | 579,960.00 | 1.57 |
| 62 | 300684 | 中石科技 | 579,135.00 | 1.57 |
| 63 | 600971 | 恒源煤电 | 560,017.00 | 1.52 |
| 64 | 601668 | 中国建筑 | 555,910.00 | 1.50 |
| 65 | 300407 | 凯发电气 | 555,180.00 | 1.50 |
| 66 | 300097 | 智云股份 | 541,908.00 | 1.47 |
| 67 | 688618 | 三旺通信 | 532,698.37 | 1.44 |
| 68 | 300624 | 万兴科技 | 531,152.00 | 1.44 |
| 69 | 300188 | 美亚柏科 | 522,044.00 | 1.41 |
| 70 | 300701 | 森霸传感 | 497,320.00 | 1.35 |
| 71 | 002560 | 通达股份 | 496,658.00 | 1.34 |
| 72 | 603037 | 凯众股份 | 495,091.00 | 1.34 |
| 73 | 600448 | 华纺股份 | 486,960.00 | 1.32 |
| 74 | 002583 | 海能达  | 485,953.00 | 1.31 |
| 75 | 000915 | 华特达因 | 477,165.00 | 1.29 |
| 76 | 600060 | 海信视像 | 477,089.00 | 1.29 |
| 77 | 002292 | 奥飞娱乐 | 472,944.00 | 1.28 |
| 78 | 300608 | 思特奇  | 471,208.00 | 1.27 |
| 79 | 603283 | 赛腾股份 | 469,330.00 | 1.27 |
| 80 | 300347 | 泰格医药 | 461,104.00 | 1.25 |
| 81 | 002410 | 广联达  | 459,976.00 | 1.24 |
| 82 | 600566 | 济川药业 | 459,424.00 | 1.24 |
| 83 | 000049 | 德赛电池 | 451,284.00 | 1.22 |
| 84 | 300725 | 药石科技 | 449,462.00 | 1.22 |
| 85 | 603355 | 莱克电气 | 446,648.00 | 1.21 |
| 86 | 688385 | 复旦微电 | 445,539.88 | 1.21 |
| 87 | 600570 | 恒生电子 | 444,150.00 | 1.20 |
| 88 | 002774 | 快意电梯 | 441,168.00 | 1.19 |
| 89 | 688566 | 吉贝尔  | 433,242.00 | 1.17 |
| 90 | 002262 | 恩华药业 | 433,080.00 | 1.17 |
| 91 | 688316 | 青云科技 | 432,122.00 | 1.17 |
| 92 | 600661 | 昂立教育 | 431,424.00 | 1.17 |
| 93 | 688701 | 卓锦股份 | 431,096.00 | 1.17 |
| 94 | 002531 | 天顺风能 | 431,055.00 | 1.17 |
| 95 | 000691 | 亚太实业 | 429,418.00 | 1.16 |
| 96 | 603958 | 哈森股份 | 428,764.00 | 1.16 |
| 97 | 603967 | 中创物流 | 423,584.00 | 1.15 |

|     |        |       |            |      |
|-----|--------|-------|------------|------|
| 98  | 603757 | 大元泵业  | 422,021.00 | 1.14 |
| 99  | 002020 | 京新药业  | 421,835.00 | 1.14 |
| 100 | 601000 | 唐山港   | 414,915.00 | 1.12 |
| 101 | 603880 | ST 南卫 | 414,253.00 | 1.12 |
| 102 | 603086 | 先达股份  | 410,297.00 | 1.11 |
| 103 | 600389 | 江山股份  | 408,094.00 | 1.10 |
| 104 | 603559 | ST 通脉 | 407,836.00 | 1.10 |
| 105 | 300314 | 戴维医疗  | 406,230.00 | 1.10 |
| 106 | 688501 | 青达环保  | 404,785.57 | 1.10 |
| 107 | 688516 | 奥特维   | 403,700.00 | 1.09 |
| 108 | 300644 | 南京聚隆  | 394,228.00 | 1.07 |
| 109 | 300554 | 三超新材  | 392,679.00 | 1.06 |
| 110 | 300591 | 万里马   | 392,125.00 | 1.06 |
| 111 | 603998 | 方盛制药  | 386,768.00 | 1.05 |
| 112 | 000878 | 云南铜业  | 386,429.00 | 1.05 |
| 113 | 300661 | 圣邦股份  | 385,158.00 | 1.04 |
| 114 | 688466 | 金科环境  | 383,746.00 | 1.04 |
| 115 | 001206 | 依依股份  | 379,577.52 | 1.03 |
| 116 | 300521 | 爱司凯   | 379,396.00 | 1.03 |
| 117 | 000597 | 东北制药  | 378,794.00 | 1.02 |
| 118 | 601518 | 吉林高速  | 378,125.00 | 1.02 |
| 119 | 603860 | 中公高科  | 374,497.00 | 1.01 |
| 120 | 300749 | 顶固集创  | 374,145.00 | 1.01 |
| 121 | 601326 | 秦港股份  | 367,110.00 | 0.99 |
| 122 | 300716 | 泉为科技  | 366,463.00 | 0.99 |
| 123 | 688081 | 兴图新科  | 364,370.00 | 0.99 |
| 124 | 300789 | 唐源电气  | 362,513.00 | 0.98 |
| 125 | 002955 | 鸿合科技  | 362,492.00 | 0.98 |
| 126 | 603496 | 恒为科技  | 361,428.00 | 0.98 |
| 127 | 300092 | 科新机电  | 359,544.00 | 0.97 |
| 128 | 688177 | 百奥泰   | 359,372.00 | 0.97 |
| 129 | 300547 | 川环科技  | 359,242.00 | 0.97 |
| 130 | 300449 | 汉邦高科  | 358,558.00 | 0.97 |
| 131 | 300637 | 扬帆新材  | 358,428.00 | 0.97 |
| 132 | 300546 | 雄帝科技  | 355,695.00 | 0.96 |
| 133 | 000890 | 法尔胜   | 355,680.00 | 0.96 |
| 134 | 600973 | 宝胜股份  | 354,697.00 | 0.96 |
| 135 | 000700 | 模塑科技  | 354,504.00 | 0.96 |

|     |        |      |            |      |
|-----|--------|------|------------|------|
| 136 | 603920 | 世运电路 | 352,666.00 | 0.95 |
| 137 | 300532 | 今天国际 | 352,433.00 | 0.95 |
| 138 | 688096 | 京源环保 | 352,194.00 | 0.95 |
| 139 | 603611 | 诺力股份 | 351,946.00 | 0.95 |
| 140 | 600362 | 江西铜业 | 350,944.00 | 0.95 |
| 141 | 300711 | 广哈通信 | 348,168.00 | 0.94 |
| 142 | 601003 | 柳钢股份 | 348,108.00 | 0.94 |
| 143 | 300514 | 友讯达  | 346,983.00 | 0.94 |
| 144 | 688579 | 山大地纬 | 345,801.00 | 0.94 |
| 145 | 600961 | 株冶集团 | 345,600.00 | 0.94 |
| 146 | 688266 | 泽璟制药 | 344,624.00 | 0.93 |
| 147 | 600250 | 南纺股份 | 344,506.00 | 0.93 |
| 148 | 002772 | 众兴菌业 | 342,108.00 | 0.93 |
| 149 | 300807 | 天迈科技 | 340,658.00 | 0.92 |
| 150 | 688367 | 工大高科 | 339,870.00 | 0.92 |
| 151 | 600651 | 飞乐音响 | 338,976.00 | 0.92 |
| 152 | 000680 | 山推股份 | 338,925.00 | 0.92 |
| 153 | 300210 | 森远股份 | 338,608.00 | 0.92 |
| 154 | 688004 | 博汇科技 | 337,636.00 | 0.91 |
| 155 | 600742 | 一汽富维 | 336,813.00 | 0.91 |
| 156 | 000900 | 现代投资 | 336,274.00 | 0.91 |
| 157 | 300616 | 尚品宅配 | 336,084.00 | 0.91 |
| 158 | 002144 | 宏达高科 | 335,637.00 | 0.91 |
| 159 | 002290 | 禾盛新材 | 334,648.00 | 0.91 |
| 160 | 300126 | 锐奇股份 | 332,177.00 | 0.90 |
| 161 | 300698 | 万马科技 | 331,384.00 | 0.90 |
| 162 | 603161 | 科华控股 | 331,263.00 | 0.90 |
| 163 | 688616 | 西力科技 | 330,120.00 | 0.89 |
| 164 | 002899 | 英派斯  | 328,242.00 | 0.89 |
| 165 | 688681 | 科汇股份 | 327,420.00 | 0.89 |
| 166 | 688619 | 罗普特  | 325,776.00 | 0.88 |
| 167 | 688517 | 金冠电气 | 325,108.00 | 0.88 |
| 168 | 000063 | 中兴通讯 | 324,950.00 | 0.88 |
| 169 | 600284 | 浦东建设 | 324,801.00 | 0.88 |
| 170 | 002802 | 洪汇新材 | 324,096.00 | 0.88 |
| 171 | 688215 | 瑞晟智能 | 323,879.00 | 0.88 |
| 172 | 600665 | 天地源  | 323,850.00 | 0.88 |
| 173 | 603876 | 鼎胜新材 | 323,295.00 | 0.87 |

|     |        |      |            |      |
|-----|--------|------|------------|------|
| 174 | 000728 | 国元证券 | 323,050.00 | 0.87 |
| 175 | 688038 | 中科通达 | 321,152.78 | 0.87 |
| 176 | 600370 | 三房巷  | 320,946.00 | 0.87 |
| 177 | 605178 | 时空科技 | 320,229.00 | 0.87 |
| 178 | 600170 | 上海建工 | 319,770.00 | 0.87 |
| 179 | 002360 | 同德化工 | 319,564.00 | 0.86 |
| 180 | 300721 | 怡达股份 | 319,342.50 | 0.86 |
| 181 | 002014 | 永新股份 | 319,308.00 | 0.86 |
| 182 | 600256 | 广汇能源 | 317,376.00 | 0.86 |
| 183 | 301007 | 德迈仕  | 317,009.00 | 0.86 |
| 184 | 688679 | 通源环境 | 316,581.46 | 0.86 |
| 185 | 300176 | 派生科技 | 316,399.00 | 0.86 |
| 186 | 688013 | 天臣医疗 | 315,666.00 | 0.85 |
| 187 | 000619 | 海螺新材 | 314,534.00 | 0.85 |
| 188 | 600888 | 新疆众和 | 314,439.00 | 0.85 |
| 189 | 301106 | 骏成科技 | 313,605.00 | 0.85 |
| 190 | 600602 | 云赛智联 | 313,278.00 | 0.85 |
| 191 | 002691 | 冀凯股份 | 313,000.00 | 0.85 |
| 192 | 000726 | 鲁泰 A | 312,894.00 | 0.85 |
| 193 | 688067 | 爱威科技 | 312,878.00 | 0.85 |
| 194 | 601126 | 四方股份 | 312,732.00 | 0.85 |
| 195 | 002849 | 威星智能 | 312,004.00 | 0.84 |
| 196 | 002377 | 国创高新 | 310,804.00 | 0.84 |
| 197 | 300549 | 优德精密 | 310,714.00 | 0.84 |
| 198 | 600234 | 科新发展 | 310,134.00 | 0.84 |
| 199 | 600982 | 宁波能源 | 309,672.00 | 0.84 |
| 200 | 300069 | 金利华电 | 309,171.00 | 0.84 |
| 201 | 600850 | 电科数字 | 308,995.00 | 0.84 |
| 202 | 603991 | 至正股份 | 308,616.00 | 0.84 |
| 203 | 603488 | 展鹏科技 | 308,248.00 | 0.83 |
| 204 | 601996 | 丰林集团 | 307,977.00 | 0.83 |
| 205 | 300106 | 西部牧业 | 307,942.00 | 0.83 |
| 206 | 300163 | 先锋新材 | 307,800.00 | 0.83 |
| 207 | 002885 | 京泉华  | 307,692.00 | 0.83 |
| 208 | 300907 | 康平科技 | 307,683.00 | 0.83 |
| 209 | 688178 | 万德斯  | 307,313.18 | 0.83 |
| 210 | 002067 | 景兴纸业 | 307,050.00 | 0.83 |
| 211 | 000513 | 丽珠集团 | 306,936.00 | 0.83 |

|     |        |      |            |      |
|-----|--------|------|------------|------|
| 212 | 002917 | 金奥博  | 306,783.00 | 0.83 |
| 213 | 600455 | 博通股份 | 306,150.00 | 0.83 |
| 214 | 603393 | 新天然气 | 305,676.00 | 0.83 |
| 215 | 300523 | 辰安科技 | 304,641.00 | 0.82 |
| 216 | 600843 | 上工申贝 | 304,390.00 | 0.82 |
| 217 | 300417 | 南华仪器 | 304,125.00 | 0.82 |
| 218 | 688109 | 品茗科技 | 303,936.00 | 0.82 |
| 219 | 300897 | 山科智能 | 303,680.00 | 0.82 |
| 220 | 603045 | 福达合金 | 303,637.00 | 0.82 |
| 221 | 603988 | 中电电机 | 303,469.00 | 0.82 |
| 222 | 601528 | 瑞丰银行 | 303,366.00 | 0.82 |
| 223 | 300717 | 华信新材 | 302,872.00 | 0.82 |
| 224 | 300756 | 金马游乐 | 302,660.00 | 0.82 |
| 225 | 603321 | 梅轮电梯 | 302,445.00 | 0.82 |
| 226 | 603166 | 福达股份 | 302,306.00 | 0.82 |
| 227 | 603299 | 苏盐井神 | 301,950.00 | 0.82 |
| 228 | 002540 | 亚太科技 | 301,768.00 | 0.82 |
| 229 | 605287 | 德才股份 | 300,730.00 | 0.81 |
| 230 | 300705 | 九典制药 | 300,246.00 | 0.81 |
| 231 | 300665 | 飞鹿股份 | 300,132.00 | 0.81 |
| 232 | 300840 | 酷特智能 | 299,975.00 | 0.81 |
| 233 | 300535 | 达威股份 | 299,475.00 | 0.81 |
| 234 | 000795 | 英洛华  | 299,390.00 | 0.81 |
| 235 | 600444 | 国机通用 | 298,850.00 | 0.81 |
| 236 | 600969 | 郴电国际 | 298,300.00 | 0.81 |
| 237 | 301022 | 海泰科  | 297,904.00 | 0.81 |
| 238 | 603861 | 白云电器 | 297,603.00 | 0.81 |
| 239 | 300626 | 华瑞股份 | 297,214.00 | 0.80 |
| 240 | 600768 | 宁波富邦 | 297,000.00 | 0.80 |
| 241 | 300478 | 杭州高新 | 296,475.00 | 0.80 |
| 242 | 603599 | 广信股份 | 296,109.00 | 0.80 |
| 243 | 300886 | 华业香料 | 294,783.00 | 0.80 |
| 244 | 002801 | 微光股份 | 293,919.00 | 0.80 |
| 245 | 603023 | 威帝股份 | 293,675.00 | 0.79 |
| 246 | 300635 | 中达安  | 292,992.00 | 0.79 |
| 247 | 002890 | 弘宇股份 | 292,632.00 | 0.79 |
| 248 | 603022 | 新通联  | 291,352.00 | 0.79 |
| 249 | 688098 | 申联生物 | 289,948.00 | 0.78 |

|     |        |        |            |      |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 250 | 603133 | *ST 碳元 | 288,072.00 | 0.78 |
| 251 | 300385 | 雪浪环境   | 287,591.00 | 0.78 |
| 252 | 300258 | 精锻科技   | 287,297.00 | 0.78 |
| 253 | 600539 | 狮头股份   | 287,240.00 | 0.78 |
| 254 | 603600 | 永艺股份   | 287,179.00 | 0.78 |
| 255 | 603856 | 东宏股份   | 286,702.00 | 0.78 |
| 256 | 300262 | 巴安水务   | 286,670.00 | 0.78 |
| 257 | 300221 | 银禧科技   | 286,426.00 | 0.77 |
| 258 | 300300 | 海峡创新   | 285,376.00 | 0.77 |
| 259 | 300675 | 建科院    | 283,008.00 | 0.77 |
| 260 | 002775 | 文科园林   | 282,734.00 | 0.76 |
| 261 | 603615 | 茶花股份   | 279,852.00 | 0.76 |
| 262 | 002918 | 蒙娜丽莎   | 278,567.00 | 0.75 |
| 263 | 000668 | 荣丰控股   | 277,095.00 | 0.75 |
| 264 | 300132 | 青松股份   | 274,844.00 | 0.74 |
| 265 | 300405 | 科隆股份   | 273,449.00 | 0.74 |
| 266 | 600561 | 江西长运   | 272,850.00 | 0.74 |
| 267 | 000100 | TCL 科技 | 270,777.00 | 0.73 |
| 268 | 603389 | 亚振家居   | 265,037.00 | 0.72 |
| 269 | 300787 | 海能实业   | 259,281.00 | 0.70 |
| 270 | 300115 | 长盈精密   | 257,854.00 | 0.70 |
| 271 | 000023 | ST 深天  | 257,136.00 | 0.70 |
| 272 | 603968 | 醋化股份   | 256,785.00 | 0.69 |
| 273 | 688365 | 光云科技   | 255,782.00 | 0.69 |
| 274 | 600213 | 亚星客车   | 254,130.00 | 0.69 |
| 275 | 002351 | 漫步者    | 224,406.00 | 0.61 |
| 276 | 600089 | 特变电工   | 220,231.00 | 0.60 |
| 277 | 300881 | 盛德鑫泰   | 206,970.00 | 0.56 |
| 278 | 600039 | 四川路桥   | 204,828.00 | 0.55 |
| 279 | 002384 | 东山精密   | 197,470.00 | 0.53 |
| 280 | 002908 | 德生科技   | 195,800.00 | 0.53 |
| 281 | 603360 | 百傲化学   | 192,600.00 | 0.52 |
| 282 | 002129 | TCL 中环 | 191,436.00 | 0.52 |
| 283 | 605088 | 冠盛股份   | 186,886.00 | 0.51 |
| 284 | 603187 | 海容冷链   | 185,315.00 | 0.50 |
| 285 | 603529 | 爱玛科技   | 177,074.00 | 0.48 |
| 286 | 000968 | 蓝焰控股   | 176,739.00 | 0.48 |
| 287 | 688600 | 皖仪科技   | 176,340.00 | 0.48 |

|     |        |      |            |      |
|-----|--------|------|------------|------|
| 288 | 300121 | 阳谷华泰 | 175,604.00 | 0.48 |
| 289 | 002737 | 葵花药业 | 174,695.00 | 0.47 |
| 290 | 601012 | 隆基绿能 | 171,444.00 | 0.46 |
| 291 | 300938 | 信测标准 | 171,183.00 | 0.46 |
| 292 | 603659 | 璞泰来  | 168,993.00 | 0.46 |
| 293 | 605507 | 国邦医药 | 168,103.00 | 0.45 |
| 294 | 002893 | 京能热力 | 167,826.00 | 0.45 |
| 295 | 600970 | 中材国际 | 161,329.00 | 0.44 |
| 296 | 600114 | 东睦股份 | 159,937.00 | 0.43 |
| 297 | 002652 | 扬子新材 | 156,825.00 | 0.42 |
| 298 | 605123 | 派克新材 | 152,240.00 | 0.41 |
| 299 | 603185 | 弘元绿能 | 145,678.00 | 0.39 |
| 300 | 601231 | 环旭电子 | 143,873.00 | 0.39 |
| 301 | 002322 | 理工能科 | 142,711.00 | 0.39 |
| 302 | 300504 | 天邑股份 | 139,060.00 | 0.38 |
| 303 | 603118 | 共进股份 | 136,109.00 | 0.37 |
| 304 | 603699 | 纽威股份 | 136,086.00 | 0.37 |
| 305 | 003019 | 宸展光电 | 132,608.00 | 0.36 |
| 306 | 600642 | 申能股份 | 132,341.00 | 0.36 |
| 307 | 600778 | 友好集团 | 130,848.00 | 0.35 |
| 308 | 002061 | 浙江交科 | 130,620.00 | 0.35 |
| 309 | 600377 | 宁沪高速 | 130,203.00 | 0.35 |
| 310 | 600463 | 空港股份 | 123,093.00 | 0.33 |
| 311 | 000048 | 京基智农 | 122,480.00 | 0.33 |
| 312 | 300422 | 博世科  | 120,400.00 | 0.33 |
| 313 | 688187 | 时代电气 | 119,265.00 | 0.32 |
| 314 | 603608 | 天创时尚 | 119,262.00 | 0.32 |
| 315 | 688395 | 正弦电气 | 119,232.82 | 0.32 |
| 316 | 688718 | 唯赛勃  | 117,368.00 | 0.32 |
| 317 | 603709 | 中源家居 | 117,150.00 | 0.32 |
| 318 | 603558 | 健盛集团 | 117,040.00 | 0.32 |
| 319 | 002249 | 大洋电机 | 115,875.00 | 0.31 |
| 320 | 002404 | 嘉欣丝绸 | 115,756.00 | 0.31 |
| 321 | 603080 | 新疆火炬 | 115,370.00 | 0.31 |
| 322 | 600057 | 厦门象屿 | 115,213.00 | 0.31 |
| 323 | 001205 | 盛航股份 | 114,745.00 | 0.31 |
| 324 | 000933 | 神火股份 | 114,048.00 | 0.31 |
| 325 | 002545 | 东方铁塔 | 113,696.00 | 0.31 |



|     |        |      |            |      |
|-----|--------|------|------------|------|
| 326 | 688379 | 华光新材 | 113,274.00 | 0.31 |
| 327 | 603301 | 振德医疗 | 111,403.00 | 0.30 |
| 328 | 002244 | 滨江集团 | 111,386.00 | 0.30 |
| 329 | 603332 | 苏州龙杰 | 111,195.00 | 0.30 |
| 330 | 600889 | 南京化纤 | 111,153.00 | 0.30 |
| 331 | 603303 | 得邦照明 | 110,671.00 | 0.30 |
| 332 | 301003 | 江苏博云 | 109,368.00 | 0.30 |
| 333 | 603139 | 康惠制药 | 107,055.00 | 0.29 |
| 334 | 688071 | 华依科技 | 106,194.00 | 0.29 |
| 335 | 300801 | 泰和科技 | 102,592.00 | 0.28 |
| 336 | 300552 | 万集科技 | 100,985.00 | 0.27 |
| 337 | 301193 | 家联科技 | 100,072.00 | 0.27 |
| 338 | 603311 | 金海高科 | 99,600.00  | 0.27 |
| 339 | 688063 | 派能科技 | 98,964.00  | 0.27 |
| 340 | 603800 | 道森股份 | 98,400.00  | 0.27 |
| 341 | 603556 | 海兴电力 | 97,498.00  | 0.26 |
| 342 | 002718 | 友邦吊顶 | 96,220.00  | 0.26 |
| 343 | 600686 | 金龙汽车 | 88,098.00  | 0.24 |
| 344 | 603551 | 奥普家居 | 78,729.00  | 0.21 |
| 345 | 000404 | 长虹华意 | 68,478.00  | 0.19 |
| 346 | 300270 | 中威电子 | 67,680.00  | 0.18 |
| 347 | 002809 | 红墙股份 | 46,816.00  | 0.13 |
| 348 | 300242 | 佳云科技 | 37,948.00  | 0.10 |
| 349 | 603758 | 秦安股份 | 24,840.00  | 0.07 |
| 350 | 300157 | 恒泰艾普 | 19,778.00  | 0.05 |
| 351 | 002746 | 仙坛股份 | 18,888.00  | 0.05 |

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 | 125,750,936.03 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 126,788,642.17 |

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**

在法律法规允许范围内，本基金基于谨慎原则，以套期保值为目的参与股指期货投资，以降低组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

无。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

**7.12.2 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。

**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 | 786.46 |
| 6  | 其他应收款 | -      |
| 7  | 待摊费用  | -      |

|   |    |        |
|---|----|--------|
| 8 | 其他 | -      |
| 9 | 合计 | 786.46 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构         |            |               |            |
|--------------|---------------|---------------|------------|---------------|------------|
|              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者         |            |
|              |               | 持有份额          | 占总份<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 754          | 57,056.44     | 10,000,527.83 | 23.25%     | 33,020,028.01 | 76.75%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 929,818.22 | 2.16%    |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 50~100            |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 10~50             |

### 8.4 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<br>基金总份额<br>比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例（%） | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|---------------|-------------------------|---------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,527.83 | 23.25                   | 10,000,527.83 | 23.25                   | 自合同生效之日起不少于三年  |
| 基金管理人高级管理人员 | 69,981.80     | 0.16                    | -             | -                       | -              |
| 基金经理等人员     | 423,230.78    | 0.98                    | -             | -                       | -              |
| 基金管理人股东     | -             | -                       | -             | -                       | -              |
| 其他          | -             | -                       | -             | -                       | -              |
| 合计          | 10,493,740.41 | 24.39                   | 10,000,527.83 | 23.25                   | 自合同生效之日起不少于三年  |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |               |
|----------------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2021年12月28日）基金份额总额 | 61,098,365.18 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 47,481,383.36 |
| 本报告期基金总申购份额                | 1,357,681.59  |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 5,818,509.11  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）   | -             |
| 本报告期期末基金份额总额               | 43,020,555.84 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于 2023 年 3 月 9 日发布公告，自 2023 年 3 月 7 日起，吕传红先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的合规总监，原合规总监徐海军先生离任。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，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，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生基金管理人及高级管理人员受到稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 渤海证券 | 2      | 252,539,578.20 | 100.00%      | 182,151.98 | 100.00%    | -  |

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

## 2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准：券商经营行为规范；具有较强的研究服务能力，包括研究及投资建议质量、报告的及时性及服务质量；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、本基金本报告期内无新增券商交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易      |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|------|-----------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|      | 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 | 88,784.15 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                        | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|-------------------------------------------------------------|-----------|------------|
| 1  | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告   | 公司网站、证券时报 | 2023年1月6日  |
| 2  | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加浦领基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告       | 公司网站、证券时报 | 2023年1月10日 |
| 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济安财富（北京）基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 公司网站、证券时报 | 2023年1月12日 |
| 4  | 渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金2022年第4季度报告                             | 公司网站      | 2023年1月20日 |
| 5  | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金2022年第4季度报告的提示性公告                         | 证券时报      | 2023年1月20日 |
| 6  | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富                                | 公司网站、证券时报 | 2023年2月7日  |

|    |                                                                     |           |            |
|----|---------------------------------------------------------------------|-----------|------------|
|    | 证券股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告                                         |           |            |
| 7  | 2023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                                | 公司网站、证券时报 | 2023年3月9日  |
| 8  | 渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告                                     | 公司网站      | 2023年3月31日 |
| 9  | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告的提示性公告                                 | 证券时报      | 2023年3月31日 |
| 10 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告               | 公司网站、证券时报 | 2023年3月31日 |
| 11 | 渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告                                 | 公司网站      | 2023年4月22日 |
| 12 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告的提示性公告                             | 证券时报      | 2023年4月22日 |
| 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财咨道信息技术有限公司、上海攀赢基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 公司网站、证券时报 | 2023年5月19日 |
| 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博时财富基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告             | 公司网站、证券时报 | 2023年6月29日 |



## § 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              | 20230101-20230630        | 10,000,527.83 | 0.00 | 0.00 | 10,000,527.83 | 23.25% |
| 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。

### 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量化成长混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金量化成长混合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、渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金在指定报刊上的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

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

渤海汇金证券资产管理有限公司

2023 年 8 月 31 日