

渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人：中泰证券股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2021 年 03 月 23 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	70
§9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	71
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	71
§10 开放式基金份额变动	72
§11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	75
§12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金
基金简称	渤海汇金新动能主题混合
场内简称	-
基金主代码	010584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 23 日
基金管理人	渤海汇金证券资产管理有限公司
基金托管人	中泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	51,035,702.00 份
基金合同存续期	-
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点布局中国新经济产业中基本面良好、具备高成长潜力的优质上市公司，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金为混合型基金，其股票投资比例占基金资产的比例为 60%-95%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将结合国内外宏观经济走势、财政货币政策、证券市场发展趋势等因素，合理的分配股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。</p> <p>(二) 新动能主题界定</p> <p>我国经济发展进入新常态，创新驱动发展战略深入实施，大众创业万众创新蓬勃兴起，以技术创新为引领，以新技术新产业新业态新模式为核心，以知识、技术、信息、数据等新生产要素为支撑的经济发展新动能正在形成。本基金所定义的新动能主题主要涵盖大力开展技术研发，发展新兴产业，扩大中高端有效供给，创造新的经济增长点以对冲传统经济动能减弱的上市公司，以及在传统产业中利用新技术、新业态进行产业改造，减少低端和无效供给，助力产业结构转型升级的上市公司。</p> <p>本基金拟投资的上市公司主要包括：</p> <p>1) 在前沿创新领域如信息技术、智能技术方面投入较大，形成一定行业竞争优势的科技企业，在申银万国一级行业中相关行业包括：电子、计算机、通信、国防军工；</p>

2) 通过发展新型能源、新型材料、新型生产工艺或构造新生产模式, 在传统产业中对排放结构进行绿色化、低碳化、循环化的升级, 或在传统产业中产业结构方面进行高端化、集群化、品牌化、信息化和智能化等转型的企业, 在申银万国一级行业中相关行业包括: 电力设备、机械设备、汽车、有色金属、基础化工、公用事业、环保;

3) 在包括医疗、教育、文化、娱乐等中高端消费中着力提升消费服务水平, 或利用大数据等手段积极创造新兴业态模式的企业, 在申银万国一级行业中相关的行业包括: 医药生物、传媒、家用电器等。

未来随着科学技术变革和产业结构升级, 本基金界定的新动能主题的范围会发生扩大或者变化, 本基金将在履行适当程序后适时调整上述主题的界定。

(三) 股票投资策略

本基金通过对公司及行业所处的基本面进行深入分析和把握, 结合个股定量指标自下而上的精选新动能主题相关股票构建投资组合。

1、定量分析

本基金将从估值水平、盈利能力、运营质量等定量指标方面对拟投资对象进行评估, 挑选出新动能主题内优质的上市公司股票。

1) 估值水平

本基金结合市场、行业与个股的估值水平来挖掘具备估值优势的上市公司, 可供选择的估值指标包括市盈率 (P/E)、市净率 (P/B)、市盈增长比率 (PEG)、自由现金流贴现 (FCFF, FCFE) 和企业价值 EV/EBITDA 等。

2) 成长性

本基金通过成长性指标分析评估上市公司的历史成长状况, 主要参考的指标包括收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等。

3) 运营质量

本基金通过运营质量指标考察上市公司的内部管理质量, 主要参考的指标包括存货周转率、应收账款周转率、每股经营现金流等。

2、定性分析

本基金在定量分析选取出的股票基础上, 深入研究公司的基本面, 从公司的核心竞争优势、持续成长能力等方面精选上市公司股票, 进行股票组合的构建并适时进行调整。

1) 核心竞争优势。重点考察公司在市场地位、技术研发水平、产品定价能力、资源禀赋、激励制度等方面的特征, 选取具有独特竞争优势的优质企业。

2) 持续成长能力。在对公司未来主营业务收入增长率

和净利润增长率分析研判的基础上，选择在较长期限内实现可持续增长的新动能主题上市公司。

（四）债券投资策略

本基金在保障流动性的基础上，有效利用基金资产进行债券投资，以提高基金资产的投资收益。

首先，通过对国内外宏观经济形势、财政政策、货币政策以及债券市场供求关系等因素的分析，结合基金资产的流动性需求，确定债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排。

其次，在上述约束条件下，综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

此外，本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究，通过对转债品种的转股溢价率、纯债溢价率、到期收益率等指标分析，寻找具有债性支撑并且兼具一定股性的品种，捕捉其投资机会。可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

（五）股指期货、国债期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为目的，参与股指期货的投资。本基金将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，选择流动性较强、交易活跃的期货合约进行空头或多头套期保值，以管理投资组合的系统性风险，提高资金使用效率。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

（六）资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济等多个因素的研究预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时在严格控制风险的情况下，综合运用多个策

	略和研究方法，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		渤海汇金证券资产管理有限公司	中泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	麻众志	武书雯
	联系电话	010-68784289	0531-68889449
	电子邮箱	mazz@bhjq.com	wusw@zts.com.cn
客户服务电话		400-651-5988/ 400-651-1717	95538
传真		022-23861651	0531-68889445
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	山东省济南市经七路 86 号
办公地址		深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	山东省济南市经七路 86 号证券大厦 10 楼 1006 室
邮政编码		518054	250001
法定代表人		刘嫣	李峰

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年3月23日 (基金合同生效 日)-2021年12月 31日	2020年	2019年
本期已实现收益	12,855,535.95	-	-
本期利润	13,394,822.51	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.1362	-	-
本期加权平均净值利润率	12.88%	-	-
本期基金份额净值增长率	5.42%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	2,768,239.67	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0542	-	-
期末基金资产净值	53,803,941.67	-	-
期末基金份额净值	1.0542	-	-
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	5.42%	-	-

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

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

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

4、本基金合同于 2021 年 3 月 23 日生效，截至本报告期末成立未满 1 年，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

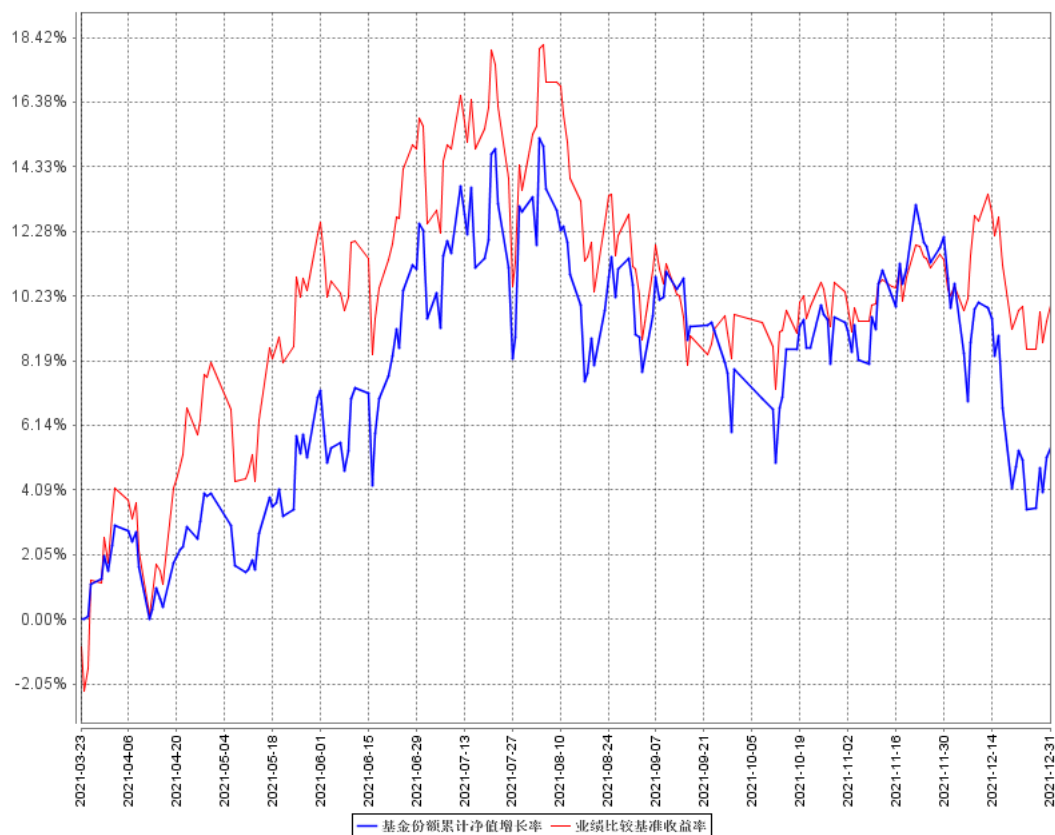
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.33%	0.98%	0.25%	0.70%	-2.58%	0.28%
过去六个月	-6.30%	1.14%	-5.11%	0.96%	-1.19%	0.18%
自基金合同 生效起至今	5.42%	1.05%	9.94%	1.01%	-4.52%	0.04%

注：业绩比较基准：中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*30%。

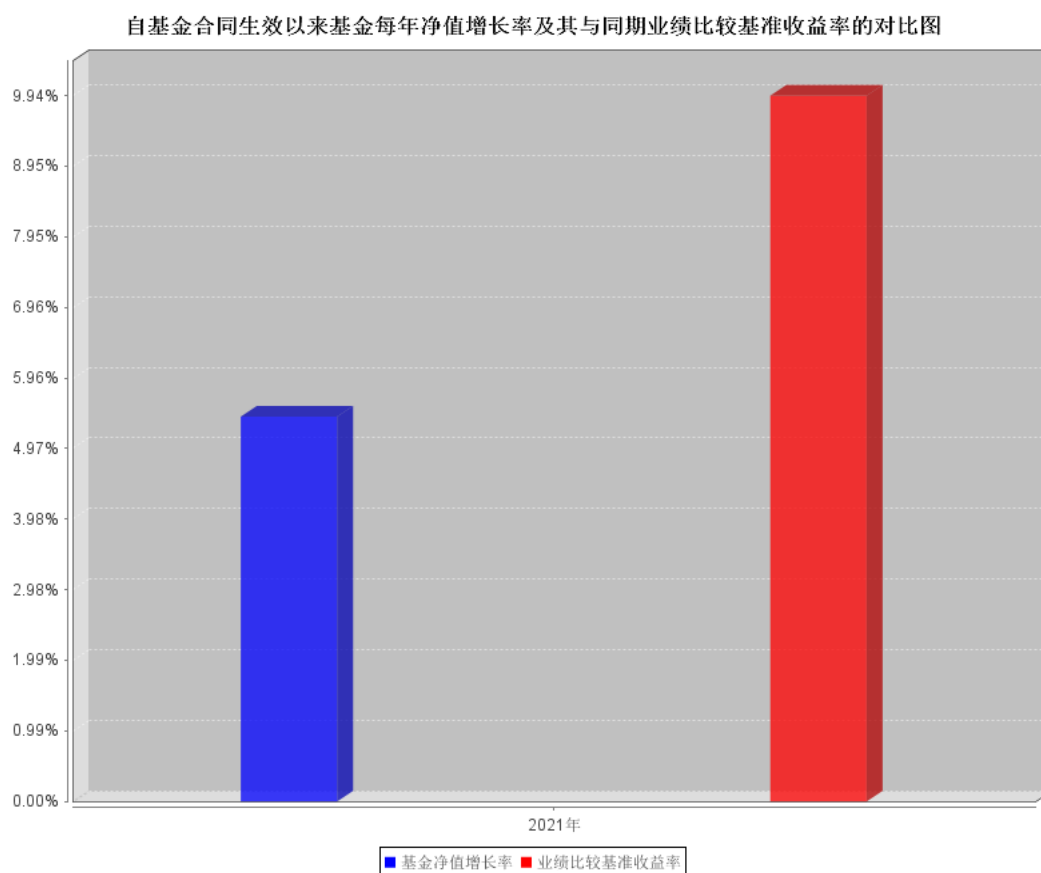
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 3 月 23 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年；
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

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



注：本基金合同于 2021 年 3 月 23 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 10 只公募基金：渤海汇金汇添金货币市场基金、渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金、渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金、渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金、渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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 3 月 23 日	-	17 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 10 日担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2018 年 2 月起担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2018 年 7 月起担任渤海汇金量化汇盈混

					合基金基金经理。2021年3月起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

4.1.4 基金经理薪酬机制

不涉及

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

证各类投资人得到公平对待。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

不涉及

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年指数整体波动不大，但结构上的波动非常剧烈，从年初的核心资产行情，到之后的周期波动，再到成长与周期的平衡。进入四季度，随着经济下行、原材料价格上涨和今年上半年基数较高等因素，交易复苏环境下中小市值公司业绩弹性的逻辑开始生变，年内强势的小盘价值、小盘成长等指数开始下跌，行业层面发改委强力调控煤价，周期板块走弱，而临近年底，市场预期整体较为混乱，部分投资者选择四季度避险保收益，市场主线模糊，配置上高低切换，行业轮动加速，板块行情持续性变差，地产监管松动和信用见底推动大盘股回暖，资金开始布局跨年行情。具体来看，2021 年上证指数、沪深 300、创业板指分别上涨 4.8%、-5.2%、12.0%。行业方面，电力设备、有色金属、煤炭涨幅居前，而家用电器、非银金融、房地产跌幅较大。

2021 年，我们坚定看好震荡格局中，部分权益资产较为确定的、高速的业绩增长所带来的市场结构性机会，基本维持新动能基金中权益仓位配置比例。行业配置方面，新动能基金作为主题型基金，锚定中国新经济新动能的长期确定性方向，优选消费升级、产业升级、排放结构升级、前沿创新等长期高成长赛道。选股方面，基金主要在新动能主题相关的选股空间内，以多风格多策略量化选股模型为基础配置股票组合，避免了单一策略的周期影响，并定期对选股策略进行再平衡，在长时间维度上获取组合配置带来的投资收益。但量化策略并不能很好的适应四季度风格剧烈切换的市场环境，这也是短期收益和净值波动受到负面影响的主要因素。从长期来看，我们相信量化策略会在市场度过这段风格剧烈切换的震荡期之后继续恢复其有效性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0542 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.42%，业绩比较基准收益率为 9.94%。

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 2022 年，基数效应导致的短期高增长将会过去，盈利增长将显著下行。流动性的边际宽

松对于市场会有所支持，同时政策的落地也会提供一定的利好，这二者能否对冲盈利增速与盈利能力的下行仍然有待观察。中美关系好转、资本市场改革的推进可能会给市场带来惊喜，而美联储的加息政策可能会成为影响全球资本市场的主要变数。2022 年二十大将召开，“稳字当头”在 A 股市场也不例外，“稳增长”也将是 2022 年投资的主线，国内稳增长政策对于市场的下行空间将提供一定的支持保护，整体市场风格也将趋于均衡，后续仍需在震荡市场环境去积极把握结构性机会。

当前的市场结构下，具备低估值的传统板块可能会成为初期政策边际效应影响的主要方向，但真正影响持续性的还将是成长性本身。那些波动较大的新兴产业领域在成长性上有着明显的相对优势，这也会成为其估值消化调整之后，重回上升轨道的内生动力。中国经济仍然处于艰难的转型阶段，经济的新动能还没有进入到成熟稳定期，无论是先进制造、科技创新还是新能源领域，都处在快速发展、供不应求的高成长期，这个时期的个股容易出现估值上的较大波动，但在确定性发展方向上我想最难能可贵的就是不畏波动的坚持。我们看到很多新兴产业领域的板块此前出现了较大幅度的调整，但其并未有基本面的实质变化和长期成长性的衰减，更多还是来自于市场情绪影响下的结构性博弈和前期上涨之后的估值消化。

既然经济新动能没有改变，而且仍在茁壮成长中，我们就没有理由去担心这个动能会就此停歇下来，它只会经过换挡之后体现出更高质量的成长。所以对于新动能这只基金，对于主题方向的长期优势我们始终怀有信心。同时作为基金管理人，我们需要做的就是不断努力优化这个主题方向下的组合，让基金能够更好的反应出新动能主题方向下的成长优势，这方面的工作必然是过往总有不足，未来仍需不断努力优化提升的，这是我们作为管理人的责任。我们会用基本面量化的方法，更多维度的刻画每一只个股，努力挖掘出那些更具成长优势并且符合新动能主题方向的公司构建组合，并始终保持组合的分散均衡配置，从而获取长期收益。

市场先生总是飘忽不定，影响着判断，让人们在短期波动中迷失和错乱。市场先生更了解人性的弱点，将人们原本的长期收益目标，时常用短期的波动斩断，这便是投资的心结。可当我们保持理性和清醒的时候，会发现中国经济的新动能引擎也才刚刚启动，所有的起步并不会始终平稳，颠簸在所难免。我们要做的就是做时间的朋友，在正确的方向上做正确的事，那么过往的波动最终不过就是我们成长路上的垫脚石。转型中的中国经济和资本市场在未来科技创新、碳达峰碳中和引领的高质量发展大方向下也有着无限的潜能。新动能，可能不是短期的风口，却依然是未来长坡厚雪的方向！

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作以法律法规、行业规范和公司制度为依据，对基金

的投资、交易、运营等环节，实施事前、事中和事后的风险管理，努力做到防范和控制风险，保证合法合规、健康持续经营，保护投资者合法权益。

本报告期内，主要监察稽核工作如下：

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

按照监管要求，完成反洗钱工作报告及报表、非居民金融账户涉税尽职调查等工作。组织开展客户适当性管理、廉洁从业、债券投资交易等多项检查。组织开展反洗钱专项等合规培训，增加合规培训覆盖面和培训力度，提升公司整体合规意识。

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，估值委员会成员由公司总经理、分管投资部门的高级管理人员、公募投资部门负责人、财务负责人、产品部及研究部负责人等人组成，负责研究、指导基金

估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。公募投资部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人的投资运作进行了监督，对基金净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P02261 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金(以下简称“渤海汇金新动能主题混合基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 3 月 23 日(基金成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了渤海汇金新动能主题混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 3 月 23 日(基金成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于渤海汇金新动能主题混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>渤海汇金证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括渤海汇金新动能主题混合基金 2021 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我</p>

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

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

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

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,017,224.88	-
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	47,838,399.30	-
其中：股票投资		47,809,528.70	-
基金投资		-	-
债券投资		28,870.60	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	-41.45	-
应收股利		-	-
应收申购款		163,081.38	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		54,018,664.11	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		112,156.61	-
应付管理人报酬		53,627.56	-
应付托管费		8,937.96	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		0.31	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	40,000.00	-
负债合计		214,722.44	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	51,035,702.00	-
未分配利润	7.4.7.10	2,768,239.67	-
所有者权益合计		53,803,941.67	-
负债和所有者权益总计		54,018,664.11	-

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0542 元，基金份额总额 51,035,702.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 3 月 23 日(基 金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		16,178,968.33	-
1. 利息收入		73,250.55	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	43,105.77	-
债券利息收入		93.27	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		30,051.51	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,478,010.37	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	14,045,452.58	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	13,420.89	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	419,136.90	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	539,286.56	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,088,420.85	-

减：二、费用		2,784,145.82	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	971,854.69	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	161,975.81	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,599,515.25	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.07	-
7. 其他费用	7.4.7.20	50,800.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,394,822.51	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,394,822.51	-

注：本财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	217,088,436.50	-	217,088,436.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,394,822.51	13,394,822.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-166,052,734.50	-10,626,582.84	-176,679,317.34
其中：1. 基金申购款	42,964,581.57	4,022,127.35	46,986,708.92
2. 基金赎回款	-209,017,316.07	-14,648,710.19	-223,666,026.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	51,035,702.00	2,768,239.67	53,803,941.67

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

注：本财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可〔2020〕2718 号《关于准予渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金注册的批复》核准，由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 216,989,409.82 元，已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2021)第 0307 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，

《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 217,088,436.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 99,026.68 份基金

份额。本基金的基金管理人为渤海汇金证券资产管理有限公司，基金托管人为中泰证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、政府机构债券、地方政府债券、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 60-95%，其中投资于本基金界定的“新动能”主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率 *30%。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 3 月 23 日(基金成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 23 日(基金成立日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括结算备付金、买入返售金融资产、应收利息和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的

公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	-	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	4,017,224.88	-
合计：	4,017,224.88	-

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	47,279,324.54	47,809,528.70	530,204.16
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	19,788.20	28,870.60	9,082.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	19,788.20	28,870.60	9,082.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		47,299,112.74	47,838,399.30	539,286.56
项目	上年度末 2020年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		-	-	-

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	-	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	587.49	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	42.56	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-671.50	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	-41.45	-

注：应收其他存款利息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所产生的应收利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	40,000.00	-
合计	40,000.00	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	217,088,436.50	217,088,436.50
本期申购	42,964,581.57	42,964,581.57
本期赎回(以“-”号填列)	-209,017,316.07	-209,017,316.07
- 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	51,035,702.00	51,035,702.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	12,855,535.95	539,286.56	13,394,822.51
本期基金份额交易产生的变动数	-4,584,245.11	-6,042,337.73	-10,626,582.84
其中：基金申购款	5,513,060.73	-1,490,933.38	4,022,127.35
基金赎回款	-10,097,305.84	-4,551,404.35	-14,648,710.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,271,290.84	-5,503,051.17	2,768,239.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	活期存款利息收入	1,810.52
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	41,295.25	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-

合计	43,105.77	-
----	-----------	---

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。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	14,045,452.58	-
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	14,045,452.58	-

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	601,764,084.85	-
减：卖出股票成本总额	587,718,632.27	-
买卖股票差价收入	14,045,452.58	-

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
----	------------------------------------	----------------------------------

	31日	
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	13,420.89	-
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	13,420.89	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金 合同生效日)至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	32,331.49	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	18,900.00	-
减：应收利息总额	10.60	-
买卖债券差价收入	13,420.89	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	419,136.90	-
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	419,136.90	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	539,286.56	-
——股票投资	530,204.16	-
——债券投资	9,082.40	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	539,286.56	-

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	1,088,420.85	-
合计	1,088,420.85	-

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,599,515.25	-
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,599,515.25	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	40,000.00	-
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
其他费用	10,800.00	-
合计	50,800.00	-

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
渤海汇金证券资产管理有限公司（“渤海汇金资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中泰证券股份有限公司（“中泰证券”）	基金托管人、基金销售机构
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

注：1、本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至 2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
渤海证券	1,034,075,897.11	83.85%	-	-
中泰证券	199,167,295.99	16.15%		

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至 2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
渤海证券	33,260.29	94.71%	-	-
中泰证券	1,859.40	5.29%		

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至 2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
渤海证券	158,900,000.00	56.59%	-	-
中泰证券	121,900,000.00	43.41%		

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
渤海证券	744,810.52	83.81%	-	-
中泰证券	143,844.30	16.19%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
-	-	-	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月23日(基金合同生 效日)至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	971,854.69
其中：支付销售机构的客 户维护费	450,954.40	-

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年3月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	161,975.81	-

注：支付基金托管人中泰证券的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年3月23日(基金合同	2020年1月1日至2020年12月

	生效日)至 2021 年 12 月 31 日	31 日
基金合同生效日 (2021 年 3 月 23 日) 持有的基金份额	5,001,291.67	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	3,700,000.00	-
报告期末持有的基金份额	1,301,291.67	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.55%	-

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

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2021 年 3 月 23 日(基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中泰证券-活期存款	-	1,810.52	-	-
中泰证券-其他存款	334,814.60	4,949.68		
渤海证券-其他存款	3,682,410.28	36,345.57		

注: 1、本基金的活期银行存款由基金托管人中泰证券保管, 按银行同业利率计息。

2、本基金的其他存款为本基金存放于渤海证券、中泰证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金, 按协议约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600941	中国移动	2021 年 12 月 24 日	2022 年 1 月 5 日	新股未上市	57.58	57.58	43,400	2,498,972.00	2,498,972.00	-
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	16.53	16.53	268	4,430.04	4,430.04	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券余额。

7.4.13 金融工具风险及管理**7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

及汇总

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	25,866.70	-
未评级	3,003.90	-
合计	28,870.60	-

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债等无债项评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金

管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原

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

本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有结算备付金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月 31日	6个月以内	6个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	4,017,224.88	-	-	-	-	4,017,224.88

交易性金融资产	-	-	-	-28,870.60	47,809,528.70	47,838,399.30
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	-	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-41.45	-41.45
应收申购款	-	-	-	-	163,081.38	163,081.38
资产总计	6,017,224.88	-	-	-28,870.60	47,972,568.63	54,018,664.11
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	112,156.61	112,156.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	53,627.56	53,627.56
应付托管费	-	-	-	-	8,937.96	8,937.96
应交税费	-	-	-	-	0.31	0.31
其他负债	-	-	-	-	40,000.00	40,000.00
负债总计	-	-	-	-	214,722.44	214,722.44
利率敏感度缺口	6,017,224.88	-	-	-28,870.60	47,757,846.19	53,803,941.67
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
资产总计	-	-	-	-	-	-
负债						
负债总计	-	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	-

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	4,878.47	-
市场利率下降 25 个基点	-4,871.74		

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020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	47,809,528.70	88.86	-	-
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	47,809,528.70	88.86	-	-

7.4.13.4.3.2 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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	1,657,322.11	-
	业绩比较基准下降 5%	-1,657,322.11	-

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	-	-	-
	合计	-	-

注：无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中属于第一层次的余额为人民币 45,306,126.66 元，属于第二层次的余额为人民币 28,870.60 元，属于第三层次的余额为人民币 2,503,402.04 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金第三层次交易性金融资产本期增加人民币 2,503,402.04 元，期末余额人民币 2,503,402.04 元。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	47,809,528.70	88.51
	其中：股票	47,809,528.70	88.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,870.60	0.05
	其中：债券	28,870.60	0.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,000,000.00	3.70
	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	4,017,224.88	7.44
8	其他各项资产	163,039.93	0.30
9	合计	54,018,664.11	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	376,360.00	0.70
C	制造业	38,238,028.05	71.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	656,320.00	1.22
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	452,126.00	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	120,802.00	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,040,914.40	5.65
J	金融业	2,270,844.80	4.22
K	房地产业	367,536.00	0.68
L	租赁和商务服务业	65,823.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	1,412,302.00	2.62
N	水利、环境和公共设施管理业	87,829.00	0.16

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	697,976.60	1.30
R	文化、体育和娱乐业	22,666.85	0.04
S	综合	-	-
	合计	47,809,528.70	88.86

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600941	中国移动	43,400	2,498,972.00	4.64
2	603290	斯达半导	3,000	1,143,000.00	2.12
3	002594	比亚迪	3,900	1,045,668.00	1.94
4	603501	韦尔股份	3,300	1,025,541.00	1.91
5	002812	恩捷股份	3,300	826,320.00	1.54
6	300124	汇川技术	11,700	802,620.00	1.49
7	002371	北方华创	2,100	728,742.00	1.35
8	600456	宝钛股份	10,000	717,800.00	1.33
9	002821	凯莱英	1,600	696,000.00	1.29
10	688012	中微公司	5,100	645,660.00	1.20
11	600436	片仔癀	1,400	612,010.00	1.14
12	603259	药明康德	5,060	600,014.80	1.12
13	300059	东方财富	16,080	596,728.80	1.11
14	300750	宁德时代	1,000	588,000.00	1.09
15	002415	海康威视	11,100	580,752.00	1.08
16	300751	迈为股份	900	578,070.00	1.07
17	000973	佛塑科技	107,200	552,080.00	1.03
18	688363	华熙生物	3,400	528,020.00	0.98
19	002709	天赐材料	4,600	527,390.00	0.98
20	600183	生益科技	22,100	520,455.00	0.97
21	600552	凯盛科技	43,800	513,336.00	0.95
22	601012	隆基股份	5,900	508,580.00	0.95
23	002241	歌尔股份	9,400	508,540.00	0.95
24	600309	万华化学	5,000	505,000.00	0.94
25	300782	卓胜微	1,540	503,272.00	0.94

26	603486	科沃斯	3,300	498,135.00	0.93
27	600900	长江电力	21,600	490,320.00	0.91
28	600036	招商银行	10,000	487,100.00	0.91
29	300014	亿纬锂能	4,100	484,538.00	0.90
30	600690	海尔智家	15,900	475,251.00	0.88
31	603185	上机数控	2,800	467,544.00	0.87
32	002459	晶澳科技	4,800	444,960.00	0.83
33	300171	东富龙	8,800	444,752.00	0.83
34	002179	中航光电	4,400	442,464.00	0.82
35	300122	智飞生物	3,500	436,100.00	0.81
36	603267	鸿远电子	2,400	430,656.00	0.80
37	300726	宏达电子	4,300	430,258.00	0.80
38	300480	光力科技	12,300	422,136.00	0.78
39	300238	冠昊生物	22,400	415,072.00	0.77
40	300573	兴齐眼药	3,000	410,400.00	0.76
41	000661	长春高新	1,500	407,100.00	0.76
42	600763	通策医疗	2,000	398,000.00	0.74
43	688278	特宝生物	13,400	392,352.00	0.73
44	688036	传音控股	2,500	392,250.00	0.73
45	600585	海螺水泥	9,400	378,820.00	0.70
46	603392	万泰生物	1,700	376,550.00	0.70
47	601899	紫金矿业	38,800	376,360.00	0.70
48	300896	爱美客	700	375,277.00	0.70
49	002996	顺博合金	25,600	374,528.00	0.70
50	300680	隆盛科技	12,000	374,400.00	0.70
51	300623	捷捷微电	11,900	374,374.00	0.70
52	300661	圣邦股份	1,200	370,800.00	0.69
53	300763	锦浪科技	1,600	370,480.00	0.69
54	000002	万科 A	18,600	367,536.00	0.68
55	688558	国盛智科	8,100	366,120.00	0.68
56	000519	中兵红箭	13,700	365,379.00	0.68
57	601318	中国平安	7,100	357,911.00	0.67
58	300601	康泰生物	3,600	354,744.00	0.66
59	601633	长城汽车	7,100	344,634.00	0.64
60	601328	交通银行	74,500	343,445.00	0.64
61	300760	迈瑞医疗	900	342,720.00	0.64
62	601615	明阳智能	13,100	341,910.00	0.64
63	601658	邮储银行	67,000	341,700.00	0.64
64	600703	三安光电	8,800	330,528.00	0.61

65	688169	石头科技	400	325,200.00	0.60
66	300759	康龙化成	2,300	324,921.00	0.60
67	300274	阳光电源	2,200	320,760.00	0.60
68	300474	景嘉微	2,100	319,620.00	0.59
69	603806	福斯特	2,340	305,487.00	0.57
70	300015	爱尔眼科	7,095	299,976.60	0.56
71	300390	天华超净	3,700	299,700.00	0.56
72	688981	中芯国际	5,500	291,445.00	0.54
73	002455	百川股份	21,600	286,200.00	0.53
74	603986	兆易创新	1,580	277,843.00	0.52
75	603127	昭衍新药	2,340	270,106.20	0.50
76	300818	耐普矿机	5,000	247,000.00	0.46
77	688319	欧林生物	6,500	232,765.00	0.43
78	600587	新华医疗	6,825	219,765.00	0.41
79	300347	泰格医药	1,700	217,260.00	0.40
80	600460	士兰微	4,000	216,800.00	0.40
81	601208	东材科技	12,490	216,701.50	0.40
82	600563	法拉电子	900	209,160.00	0.39
83	300363	博腾股份	2,300	205,735.00	0.38
84	600519	贵州茅台	100	205,000.00	0.38
85	002460	赣锋锂业	1,400	199,990.00	0.37
86	002240	盛新锂能	3,300	191,235.00	0.36
87	300708	聚灿光电	9,900	182,259.00	0.34
88	300319	麦捷科技	11,500	175,950.00	0.33
89	002517	恺英网络	29,800	173,436.00	0.32
90	688005	容百科技	1,500	173,370.00	0.32
91	002881	美格智能	4,000	171,520.00	0.32
92	688396	华润微	2,600	167,960.00	0.31
93	601985	中国核电	20,000	166,000.00	0.31
94	002860	星帅尔	6,800	165,920.00	0.31
95	300450	先导智能	2,220	165,101.40	0.31
96	600111	北方稀土	3,600	164,880.00	0.31
97	002556	辉隆股份	12,600	162,162.00	0.30
98	002263	大东南	41,000	160,310.00	0.30
99	603181	皇马科技	8,300	159,194.00	0.30
100	002859	洁美科技	4,200	156,240.00	0.29
101	000301	东方盛虹	8,000	154,720.00	0.29
102	002915	中欣氟材	5,400	154,494.00	0.29
103	301093	华兰股份	2,900	151,380.00	0.28

104	002135	东南网架	12,900	149,124.00	0.28
105	300672	国科微	800	148,400.00	0.28
106	600110	诺德股份	9,300	148,335.00	0.28
107	300747	锐科激光	2,500	147,775.00	0.27
108	605277	新亚电子	4,800	146,256.00	0.27
109	300852	四会富仕	2,500	146,050.00	0.27
110	688030	山石网科	4,900	145,334.00	0.27
111	300755	华致酒行	2,900	145,232.00	0.27
112	000062	深圳华强	8,400	144,732.00	0.27
113	000565	渝三峡 A	21,600	144,072.00	0.27
114	002760	凤形股份	5,400	141,048.00	0.26
115	688298	东方生物	600	138,300.00	0.26
116	002545	东方铁塔	15,100	137,712.00	0.26
117	300915	海融科技	2,400	137,304.00	0.26
118	688168	安博通	2,200	136,554.00	0.25
119	600760	中航沈飞	2,000	136,080.00	0.25
120	000987	越秀金控	15,600	135,720.00	0.25
121	002098	浔兴股份	19,900	135,320.00	0.25
122	300160	秀强股份	17,500	133,875.00	0.25
123	300821	东岳硅材	7,300	133,444.00	0.25
124	603260	合盛硅业	1,000	131,970.00	0.25
125	002407	多氟多	2,900	130,471.00	0.24
126	300833	浩洋股份	1,600	129,648.00	0.24
127	600884	杉杉股份	3,900	127,803.00	0.24
128	000063	中兴通讯	3,700	123,950.00	0.23
129	000507	珠海港	18,700	120,802.00	0.22
130	000425	徐工机械	19,900	119,201.00	0.22
131	300503	昊志机电	8,800	113,168.00	0.21
132	002271	东方雨虹	2,100	110,628.00	0.21
133	002648	卫星化学	2,200	88,066.00	0.16
134	002475	立讯精密	1,600	78,720.00	0.15
135	603588	高能环境	4,100	72,037.00	0.13
136	600438	通威股份	1,500	67,440.00	0.13
137	601888	中国中免	300	65,823.00	0.12
138	600276	恒瑞医药	1,200	60,852.00	0.11
139	000333	美的集团	800	59,048.00	0.11
140	603899	晨光文具	900	58,059.00	0.11
141	601100	恒立液压	700	57,260.00	0.11
142	300999	金龙鱼	900	56,637.00	0.11

143	000651	格力电器	1,500	55,545.00	0.10
144	600887	伊利股份	1,300	53,898.00	0.10
145	002466	天齐锂业	500	53,500.00	0.10
146	688111	金山办公	200	53,000.00	0.10
147	603288	海天味业	500	52,555.00	0.10
148	000568	泸州老窖	200	50,774.00	0.09
149	600031	三一重工	2,200	50,160.00	0.09
150	000858	五粮液	200	44,532.00	0.08
151	605089	味知香	370	35,094.50	0.07
152	603799	华友钴业	300	33,093.00	0.06
153	600406	国电南瑞	680	27,220.40	0.05
154	600660	福耀玻璃	500	23,570.00	0.04
155	600426	华鲁恒升	600	18,780.00	0.03
156	603129	春风动力	100	17,300.00	0.03
157	603230	内蒙新华	655	16,944.85	0.03
158	001296	长江材料	269	15,946.32	0.03
159	300614	百川畅银	329	15,792.00	0.03
160	300316	晶盛机电	200	13,900.00	0.03
161	605180	华生科技	384	13,555.20	0.03
162	300993	玉马遮阳	410	11,771.10	0.02
163	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.02
164	301011	华立科技	175	10,535.00	0.02
165	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.02
166	002601	龙佰集团	300	8,577.00	0.02
167	300991	创益通	254	8,359.14	0.02
168	000001	平安银行	500	8,240.00	0.02
169	688126	沪硅产业	300	7,746.00	0.01
170	002311	海大集团	100	7,330.00	0.01
171	002410	广联达	100	6,398.00	0.01
172	002706	良信股份	350	6,237.00	0.01
173	300413	芒果超媒	100	5,722.00	0.01
174	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.01
175	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.01
176	300992	泰福泵业	200	4,950.00	0.01
177	001234	泰慕士	268	4,430.04	0.01
178	002286	保龄宝	200	2,704.00	0.01
179	000157	中联重科	200	1,434.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601012	隆基股份	8,342,680.00	15.51
2	300122	智飞生物	8,102,098.00	15.06
3	002271	东方雨虹	7,581,192.00	14.09
4	603290	斯达半导	7,479,978.00	13.90
5	600031	三一重工	7,357,744.00	13.68
6	000661	长春高新	7,080,539.88	13.16
7	603259	药明康德	7,040,486.37	13.09
8	002241	歌尔股份	6,882,373.00	12.79
9	600763	通策医疗	6,741,742.00	12.53
10	600309	万华化学	6,592,221.54	12.25
11	688012	中微公司	6,056,487.19	11.26
12	603501	韦尔股份	5,953,954.00	11.07
13	300124	汇川技术	5,747,775.00	10.68
14	002415	海康威视	5,682,201.00	10.56
15	300059	东方财富	5,470,979.40	10.17
16	300760	迈瑞医疗	5,418,246.00	10.07
17	300896	爱美客	5,240,510.60	9.74
18	601100	恒立液压	5,100,163.00	9.48
19	300014	亿纬锂能	5,076,318.46	9.43
20	600436	片仔癀	4,895,364.00	9.10
21	300750	宁德时代	4,885,926.00	9.08
22	002594	比亚迪	4,883,309.00	9.08
23	300274	阳光电源	4,794,269.00	8.91
24	688363	华熙生物	4,725,263.52	8.78
25	600276	恒瑞医药	3,825,213.00	7.11
26	002475	立讯精密	3,770,002.00	7.01
27	002812	恩捷股份	3,763,936.00	7.00
28	300015	爱尔眼科	3,629,244.00	6.75
29	600183	生益科技	3,418,427.00	6.35
30	002371	北方华创	3,305,431.00	6.14
31	300782	卓胜微	3,304,257.00	6.14

32	600703	三安光电	3,211,046.00	5.97
33	688981	中芯国际	3,082,971.31	5.73
34	002821	凯莱英	3,058,454.00	5.68
35	300751	迈为股份	2,959,083.00	5.50
36	603486	科沃斯	2,862,703.00	5.32
37	600887	伊利股份	2,815,680.15	5.23
38	300502	新易盛	2,763,295.00	5.14
39	688169	石头科技	2,741,305.50	5.09
40	600036	招商银行	2,723,844.00	5.06
41	603185	上机数控	2,722,291.00	5.06
42	000002	万科 A	2,688,552.00	5.00
43	603127	昭衍新药	2,659,294.20	4.94
44	300347	泰格医药	2,590,430.00	4.81
45	300413	芒果超媒	2,552,113.00	4.74
46	600900	长江电力	2,551,970.00	4.74
47	688036	传音控股	2,513,672.59	4.67
48	600941	中国移动	2,498,972.00	4.64
49	688188	柏楚电子	2,473,321.16	4.60
50	603986	兆易创新	2,373,947.00	4.41
51	300474	景嘉微	2,371,683.00	4.41
52	300999	金龙鱼	2,294,338.00	4.26
53	600596	新安股份	2,261,140.00	4.20
54	603008	喜临门	2,214,816.00	4.12
55	688298	东方生物	2,212,005.35	4.11
56	300415	伊之密	2,205,777.00	4.10
57	600956	新天绿能	2,130,102.00	3.96
58	002311	海大集团	2,107,824.00	3.92
59	603786	科博达	2,103,315.00	3.91
60	002436	兴森科技	2,071,775.00	3.85
61	002460	赣锋锂业	2,038,447.00	3.79
62	601865	福莱特	2,006,684.00	3.73
63	603605	珀莱雅	1,997,050.00	3.71
64	002747	埃斯顿	1,972,532.00	3.67
65	300496	中科创达	1,929,837.00	3.59
66	002142	宁波银行	1,906,470.00	3.54
67	601633	长城汽车	1,831,001.00	3.40

68	688111	金山办公	1,827,175.70	3.40
69	601615	明阳智能	1,819,956.00	3.38
70	603195	公牛集团	1,818,114.00	3.38
71	300144	宋城演艺	1,811,534.00	3.37
72	600660	福耀玻璃	1,785,125.00	3.32
73	600460	士兰微	1,780,521.10	3.31
74	002028	思源电气	1,778,230.00	3.31
75	300458	全志科技	1,729,082.00	3.21
76	603737	三棵树	1,652,852.00	3.07
77	600176	中国巨石	1,639,446.71	3.05
78	002925	盈趣科技	1,630,487.80	3.03
79	300470	中密控股	1,628,433.60	3.03
80	002714	牧原股份	1,621,110.60	3.01
81	603901	永创智能	1,619,110.00	3.01
82	002930	宏川智慧	1,616,189.00	3.00
83	300363	博腾股份	1,615,214.00	3.00
84	600171	上海贝岭	1,600,108.98	2.97
85	300482	万孚生物	1,599,166.00	2.97
86	600740	山西焦化	1,582,425.00	2.94
87	002603	以岭药业	1,580,639.00	2.94
88	002414	高德红外	1,574,866.00	2.93
89	601966	玲珑轮胎	1,573,415.00	2.92
90	000651	格力电器	1,567,932.00	2.91
91	300748	金力永磁	1,565,201.62	2.91
92	688139	海尔生物	1,551,789.27	2.88
93	002202	金风科技	1,550,848.00	2.88
94	603416	信捷电气	1,547,037.00	2.88
95	600141	兴发集团	1,544,257.00	2.87
96	002484	江海股份	1,538,217.00	2.86
97	603982	泉峰汽车	1,535,552.00	2.85
98	601208	东材科技	1,533,165.00	2.85
99	600926	杭州银行	1,527,063.00	2.84
100	603806	福斯特	1,495,106.00	2.78
101	603298	杭叉集团	1,472,434.00	2.74
102	000725	京东方 A	1,470,779.00	2.73
103	002799	环球印务	1,465,327.60	2.72

104	600577	精达股份	1,464,112.00	2.72
105	002610	爱康科技	1,464,074.00	2.72
106	002326	永太科技	1,433,491.00	2.66
107	600690	海尔智家	1,418,719.00	2.64
108	600111	北方稀土	1,412,703.00	2.63
109	600519	贵州茅台	1,401,693.59	2.61
110	002092	中泰化学	1,395,221.00	2.59
111	688002	睿创微纳	1,380,346.80	2.57
112	603587	地素时尚	1,375,265.20	2.56
113	002918	蒙娜丽莎	1,369,985.00	2.55
114	002155	湖南黄金	1,357,234.00	2.52
115	603583	捷昌驱动	1,351,226.00	2.51
116	000848	承德露露	1,340,021.00	2.49
117	603612	索通发展	1,330,304.00	2.47
118	002407	多氟多	1,329,682.00	2.47
119	300497	富祥药业	1,296,833.00	2.41
120	688396	华润微	1,283,694.20	2.39
121	603811	诚意药业	1,274,029.00	2.37
122	002709	天赐材料	1,272,863.00	2.37
123	601318	中国平安	1,271,217.00	2.36
124	601899	紫金矿业	1,268,267.00	2.36
125	002987	京北方	1,266,834.00	2.35
126	002156	通富微电	1,250,901.00	2.32
127	601658	邮储银行	1,243,646.00	2.31
128	300036	超图软件	1,235,627.60	2.30
129	605168	三人行	1,225,587.13	2.28
130	002036	联创电子	1,222,103.00	2.27
131	600985	淮北矿业	1,220,831.00	2.27
132	603326	我乐家居	1,220,412.00	2.27
133	600563	法拉电子	1,212,204.00	2.25
134	002931	锋龙股份	1,196,128.00	2.22
135	603338	浙江鼎力	1,195,443.00	2.22
136	300339	润和软件	1,189,364.00	2.21
137	002539	云图控股	1,188,956.00	2.21
138	300655	晶瑞电材	1,187,018.59	2.21
139	000932	华菱钢铁	1,182,079.00	2.20

140	603444	吉比特	1,163,432.00	2.16
141	601068	中铝国际	1,159,528.00	2.16
142	300543	朗科智能	1,148,194.00	2.13
143	002230	科大讯飞	1,133,800.00	2.11
144	300541	先进数通	1,133,229.00	2.11
145	300763	锦浪科技	1,121,762.40	2.08
146	603995	甬金股份	1,121,248.00	2.08
147	688181	八亿时空	1,116,257.00	2.07
148	300501	海顺新材	1,114,672.00	2.07
149	300568	星源材质	1,110,703.00	2.06
150	300379	东方通	1,088,670.60	2.02
151	600063	皖维高新	1,083,988.00	2.01
152	600522	中天科技	1,083,643.00	2.01
153	601328	交通银行	1,079,052.00	2.01

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基股份	8,965,724.00	16.66
2	002271	东方雨虹	8,055,101.00	14.97
3	300122	智飞生物	7,664,407.00	14.25
4	002241	歌尔股份	7,286,840.00	13.54
5	603259	药明康德	7,184,300.20	13.35
6	600031	三一重工	6,913,107.00	12.85
7	603290	斯达半导	6,726,458.00	12.50
8	000661	长春高新	6,152,775.00	11.44
9	600309	万华化学	6,127,889.00	11.39
10	600763	通策医疗	6,125,050.00	11.38
11	300059	东方财富	5,663,674.80	10.53
12	300750	宁德时代	5,530,254.00	10.28
13	300124	汇川技术	5,385,640.00	10.01
14	300760	迈瑞医疗	5,355,750.30	9.95
15	603501	韦尔股份	5,292,424.34	9.84
16	002415	海康威视	5,260,722.00	9.78

17	300014	亿纬锂能	5,256,577.00	9.77
18	600436	片仔癀	5,256,156.00	9.77
19	688012	中微公司	5,108,336.67	9.49
20	300274	阳光电源	5,013,004.00	9.32
21	601100	恒立液压	4,831,228.00	8.98
22	300896	爱美客	4,676,774.00	8.69
23	002594	比亚迪	4,222,076.00	7.85
24	002475	立讯精密	4,042,195.00	7.51
25	688363	华熙生物	3,832,426.34	7.12
26	300015	爱尔眼科	3,618,098.00	6.72
27	600276	恒瑞医药	3,472,487.00	6.45
28	002812	恩捷股份	3,469,870.00	6.45
29	002371	北方华创	3,174,329.51	5.90
30	600703	三安光电	3,018,342.00	5.61
31	300502	新易盛	2,990,307.04	5.56
32	603486	科沃斯	2,906,595.00	5.40
33	688981	中芯国际	2,812,628.16	5.23
34	600183	生益科技	2,808,124.00	5.22
35	300751	迈为股份	2,788,674.00	5.18
36	300782	卓胜微	2,718,854.00	5.05
37	600887	伊利股份	2,705,625.00	5.03
38	300413	芒果超媒	2,677,249.60	4.98
39	002821	凯莱英	2,652,818.00	4.93
40	603185	上机数控	2,458,551.00	4.57
41	300363	博腾股份	2,411,814.00	4.48
42	603008	喜临门	2,399,948.00	4.46
43	300347	泰格医药	2,398,562.00	4.46
44	603127	昭衍新药	2,379,919.00	4.42
45	600596	新安股份	2,364,961.00	4.40
46	688188	柏楚电子	2,342,956.53	4.35
47	600036	招商银行	2,329,167.00	4.33
48	603986	兆易创新	2,318,002.00	4.31
49	688169	石头科技	2,310,067.00	4.29
50	300496	中科创达	2,267,149.00	4.21
51	600956	新天绿能	2,245,567.00	4.17
52	688298	东方生物	2,228,601.88	4.14
53	300415	伊之密	2,215,615.00	4.12
54	300999	金龙鱼	2,206,837.00	4.10

55	601865	福莱特	2,197,473.00	4.08
56	002311	海大集团	2,159,967.00	4.01
57	000002	万科 A	2,133,016.90	3.96
58	300474	景嘉微	2,100,877.00	3.90
59	603786	科博达	2,082,606.00	3.87
60	002460	赣锋锂业	2,061,204.00	3.83
61	002436	兴森科技	2,025,767.00	3.77
62	600900	长江电力	1,987,430.00	3.69
63	603605	珀莱雅	1,986,985.00	3.69
64	002142	宁波银行	1,959,931.00	3.64
65	002747	埃斯顿	1,944,950.00	3.61
66	601208	东材科技	1,929,100.40	3.59
67	600660	福耀玻璃	1,919,123.00	3.57
68	688036	传音控股	1,857,842.64	3.45
69	300144	宋城演艺	1,844,407.39	3.43
70	603737	三棵树	1,838,312.00	3.42
71	603195	公牛集团	1,762,188.00	3.28
72	300458	全志科技	1,749,373.00	3.25
73	002414	高德红外	1,725,909.00	3.21
74	688111	金山办公	1,716,074.00	3.19
75	600460	士兰微	1,691,268.00	3.14
76	002930	宏川智慧	1,675,288.00	3.11
77	600176	中国巨石	1,660,542.00	3.09
78	002603	以岭药业	1,640,619.00	3.05
79	002202	金风科技	1,638,079.00	3.04
80	601966	玲珑轮胎	1,624,752.00	3.02
81	603901	永创智能	1,624,712.00	3.02
82	603982	泉峰汽车	1,621,268.00	3.01
83	600740	山西焦化	1,618,963.00	3.01
84	002028	思源电气	1,617,665.00	3.01
85	300748	金力永磁	1,603,753.00	2.98
86	002925	盈趣科技	1,602,850.00	2.98
87	601633	长城汽车	1,596,848.00	2.97
88	600171	上海贝岭	1,567,887.00	2.91
89	002714	牧原股份	1,565,309.20	2.91
90	600141	兴发集团	1,559,378.00	2.90
91	000725	京东方 A	1,545,795.00	2.87
92	688139	海尔生物	1,530,703.60	2.84

93	601615	明阳智能	1,518,711.00	2.82
94	002610	爱康科技	1,507,678.00	2.80
95	600926	杭州银行	1,484,070.00	2.76
96	002484	江海股份	1,478,306.00	2.75
97	002799	环球印务	1,475,143.00	2.74
98	002326	永太科技	1,457,809.00	2.71
99	600577	精达股份	1,430,377.00	2.66
100	603806	福斯特	1,423,032.00	2.64
101	300470	中密控股	1,420,449.00	2.64
102	000651	格力电器	1,403,881.00	2.61
103	002155	湖南黄金	1,384,982.00	2.57
104	300482	万孚生物	1,375,920.40	2.56
105	300497	富祥药业	1,364,784.00	2.54
106	603583	捷昌驱动	1,363,528.00	2.53
107	603416	信捷电气	1,359,401.00	2.53
108	002092	中泰化学	1,353,337.00	2.52
109	603587	地素时尚	1,344,193.00	2.50
110	688002	睿创微纳	1,336,564.73	2.48
111	603298	杭叉集团	1,307,365.00	2.43
112	002918	蒙娜丽莎	1,304,473.00	2.42
113	603612	索通发展	1,295,982.00	2.41
114	000848	承德露露	1,292,866.00	2.40
115	300543	朗科智能	1,286,903.00	2.39
116	002036	联创电子	1,282,927.00	2.38
117	002230	科大讯飞	1,273,869.00	2.37
118	600563	法拉电子	1,270,932.00	2.36
119	300036	超图软件	1,268,807.00	2.36
120	002156	通富微电	1,252,839.00	2.33
121	600111	北方稀土	1,252,802.00	2.33
122	300339	润和软件	1,245,953.00	2.32
123	603811	诚意药业	1,233,239.00	2.29
124	600985	淮北矿业	1,204,268.00	2.24
125	300541	先进数通	1,189,971.00	2.21
126	002931	锋龙股份	1,187,707.00	2.21
127	300655	晶瑞电材	1,183,190.00	2.20
128	601068	中铝国际	1,181,628.00	2.20
129	002987	京北方	1,175,738.00	2.19
130	002539	云图控股	1,175,432.00	2.18

131	600522	中天科技	1,169,887.00	2.17
132	688181	八亿时空	1,169,341.81	2.17
133	603338	浙江鼎力	1,166,611.00	2.17
134	600519	贵州茅台	1,166,213.00	2.17
135	688006	杭可科技	1,148,454.00	2.13
136	002407	多氟多	1,138,170.00	2.12
137	300501	海顺新材	1,136,946.00	2.11
138	603326	我乐家居	1,135,302.00	2.11
139	688396	华润微	1,126,224.94	2.09
140	002335	科华数据	1,124,467.00	2.09
141	300568	星源材质	1,106,088.00	2.06
142	605168	三人行	1,105,234.00	2.05
143	603158	腾龙股份	1,099,155.00	2.04
144	600529	山东药玻	1,098,307.00	2.04
145	603995	甬金股份	1,095,694.00	2.04
146	603279	景津环保	1,091,599.00	2.03
147	603444	吉比特	1,085,412.00	2.02
148	300379	东方通	1,080,685.00	2.01

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。

8.4.3 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	634,997,956.81
卖出股票收入（成交）总额	601,764,084.85

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,003.90	0.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	25,866.70	0.05

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,870.60	0.05

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123127	耐普转债	100	16,794.00	0.03
2	113633	科沃转债	70	9,072.70	0.02
3	019547	16 国债 19	30	3,003.90	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					0.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

8.12.2 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

8.12.3 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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-41.45
5	应收申购款	163,081.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	163,039.93

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600941	中国移动	2,498,972.00	4.64	新股未上市

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,105	46,186.16	1,392,220.23	2.73%	49,643,481.77	97.27%

9.2 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	1,862,812.90	3.65%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

注：不涉及，期末无兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年3月23日）基金份额总额	217,088,436.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	42,964,581.57
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	209,017,316.07
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	51,035,702.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金基金管理人重大人事变动：

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

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

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

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

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

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本基金基金托管人重大人事变动：

本基金托管人于 2021 年 3 月 23 日发布公告，托管部高级管理人员进行了调整，聘任韩琛同志为托管部总经理，刘凯同志不再担任托管部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

未发生投资政策改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金管理人于 2021 年 10 月 27 日发布了《渤海汇金证券资产管理有限公司改聘会计师事务所公告》的公告，自 2021 年 10 月 25 日起，本基金的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)变更为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。本报告期应支付审计费用 40,000.00 元。截至本报告期末，该审计机构已为本基金提供审计服务 3 个月。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受到稽查或者处罚的情况。

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
渤海证券	2	1,034,075,897.11	83.85%	744,810.52	83.81%	-
中泰证券	2	199,167,295.99	16.15%	143,844.30	16.19%	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

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

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

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

4、本基金本报告期内无新增券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
渤海证券	33,260.29	94.71%	158,900,000.00	56.59%	-	-

中泰证券	1,859.40	5.29%	121,900,000.00	43.41%	-	-
------	----------	-------	----------------	--------	---	---

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、公司网站	2021年2月18日
2	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金产品资料概要	公司网站	2021年2月18日
3	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书提示性公告	中国证券报	2021年2月18日
4	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书	公司网站	2021年2月18日
5	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2021年2月18日
6	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同提示性公告	中国证券报	2021年2月18日
7	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2021年2月18日
8	关于旗下部分基金增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021年2月26日
9	关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021年2月26日
10	关于旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021年2月26日
11	关于旗下渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金开展直销渠道	中国证券报、公司网站	2021年2月28日

	费率优惠活动的公告		
12	渤海汇金 关于旗下渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金参与渤海证券股份有限公司分支机构柜台认购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 3 日
13	渤海汇金证券资产管理有限公司关于停止旗下渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金直销渠道、渤海证券分支机构柜台费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 4 日
14	关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金延长募集期的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 12 日
15	关于旗下部分基金参加华瑞保险销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 17 日
16	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（副总经理）变更公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 20 日
17	关于旗下部分基金在部分三方代销平台开通基金定投业务的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 23 日
18	关于旗下部分基金增加民生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	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 24 日
19	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、公司网站	2021 年 3 月 24 日
20	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站	2021 年 4 月 22 日
21	渤海汇金新动能主题混合型证券	中国证券报、公司网站	2021 年 5 月 20 日

	投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告		
22	关于旗下部分基金在渤海证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务及参与基金费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 5 月 31 日
23	关于旗下部分基金增加上海万得为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 6 月 28 日
24	关于旗下部分基金增加北京广源达信基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 7 月 2 日
25	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证券报	2021 年 7 月 21 日
26	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证券报、公司网站	2021 年 7 月 21 日
27	关于旗下部分基金增加宁波银行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	中国证券报、公司网站	2021 年 7 月 23 日
28	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员(合规总监)变更公告	中国证券报、公司网站	2021 年 8 月 5 日
29	关于旗下部分基金增加一路财富(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	中国证券报、公司网站	2021 年 8 月 16 日
30	关于旗下部分基金增加上海爱建	中国证券报、公司网站	2021 年 8 月 25 日

	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		
31	关于旗下部分基金增加东吴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	中国证券报、公司网站	2021 年 8 月 27 日
32	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2021 年中期报告的提示性公告	中国证券报	2021 年 8 月 31 日
33	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2021 年中期报告	公司网站	2021 年 8 月 31 日
34	关于旗下部分基金增加招商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	中国证券报、公司网站	2021 年 9 月 3 日
35	关于旗下部分基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 10 月 18 日
36	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 3 季度报告的提示性公告	中国证券报	2021 年 10 月 27 日
37	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	公司网站	2021 年 10 月 27 日
38	渤海汇金证券资产管理有限公司改聘会计师事务所公告	中国证券报、公司网站	2021 年 10 月 27 日
39	关于旗下部分基金增加北京度小满基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 11 月 19 日
40	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（财务负	中国证券报、公司网站	2021 年 11 月 23 日

	责人) 变更公告		
41	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站	2021 年 11 月 28 日
42	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同 (2021 年 12 月修订)	公司网站	2021 年 12 月 29 日
43	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金托管协议 (2021 年 12 月修订)	公司网站	2021 年 12 月 29 日
44	关于渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金更新新动能主题行业界定并修订基金合同和托管协议的公告	中国证券报、公司网站	2021 年 12 月 29 日
45	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同提示性公告	中国证券报	2021 年 12 月 29 日
46	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金产品资料概要 (更新)	公司网站	2021 年 12 月 30 日
47	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书提示性公告	中国证券报	2021 年 12 月 30 日
48	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书 (更新) (2021 年第 1 号)	公司网站	2021 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金在指定报刊上的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-5988/400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

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

渤海汇金证券资产管理有限公司

2022 年 3 月 31 日