

渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式
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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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

| | |
|--|-----------|
| §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 | 6 |
| 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..... | 9 |
| 2.5 其他相关资料..... | 9 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 10 |
| 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 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 14 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 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..... | 15 |
| 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..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| §5 托管人报告 | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 17 |
| 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..... | 17 |
| 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..... | 17 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 18 |
| 6.1 资产负债表..... | 18 |
| 6.2 利润表..... | 19 |

| | |
|--|-----------|
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 20 |
| 6.4 报表附注..... | 22 |
| §7 投资组合报告..... | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 44 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 44 |
| 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..... | 45 |
| 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..... | 45 |
| 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..... | 45 |
| 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..... | 45 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 45 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 46 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 47 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 47 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 47 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 48 |
| §10 重大事件揭示..... | 49 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 49 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 49 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 49 |
| 10.8 其他重大事件..... | 50 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 52 |

| | |
|---|-----------|
| 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..... | 52 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 52 |
| §12 备查文件目录..... | 53 |
| 12.1 备查文件目录..... | 53 |
| 12.2 存放地点..... | 53 |
| 12.3 查阅方式..... | 53 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

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

2) 久期调整策略

债券投资受利率风险的影响。本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。

当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期值，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升收益；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以规避债券价格下降的风险带来的资本损失，获得较高的再投资收益。

3) 收益率曲线配置策略

本基金将综合考察收益率曲线和信用利差曲线，通过预期收益率曲线形态变化和信用利差曲线走势来调整投资组合的头寸。

在考察收益率曲线的基础上，本基金将确定采用集中策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变和不同期限信用债券的相对价格变化中获利。一般而言，当预期收益率曲线变陡时，本基金将采用集中策略；当预期收益率曲线变平时，将采用哑铃策略；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采用梯形策略。

本基金还将通过研究影响信用利差曲线的经济周期、市场供求关系和流动性变化等因素，确定信用债券的行业配置和各信用级别信用债券所占投资比例。

4) 基于信用变化策略

信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基金将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析和公司发展前景分析等细致的调查研究，依靠本基金内部信用评级系统建立信用债券的内部评级，分析违约风险及合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。

5) 息差策略

当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购并将所融入的资金投资于债券，从而获取债券收益率超出回购资金成本（即回购利率）的套利价值。

6) 信用债券精选策略

本基金将根据信用债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税负特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，建立不同品种的收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，重点选择具备以下特征的信用债券：较高到期收益率、较高当期收入、价

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

| | | |
|-------|--|----------------------------|
| 传真 | 022-23861651 | 021-62159217 |
| 注册地址 | 深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址 | 深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼 |
| 邮政编码 | 518054 | 200120 |
| 法定代表人 | 齐朝晖 | 吕家进 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | https://www.bhhjamc.com |
| 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 | 7,562,903.10 |
| 本期利润 | 9,234,402.64 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0181 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.77% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.80% |
| 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 | 5,152,618.92 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0101 |
| 期末基金资产净值 | 515,586,423.64 |
| 期末基金份额净值 | 1.0110 |
| 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 | 6.24% |

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

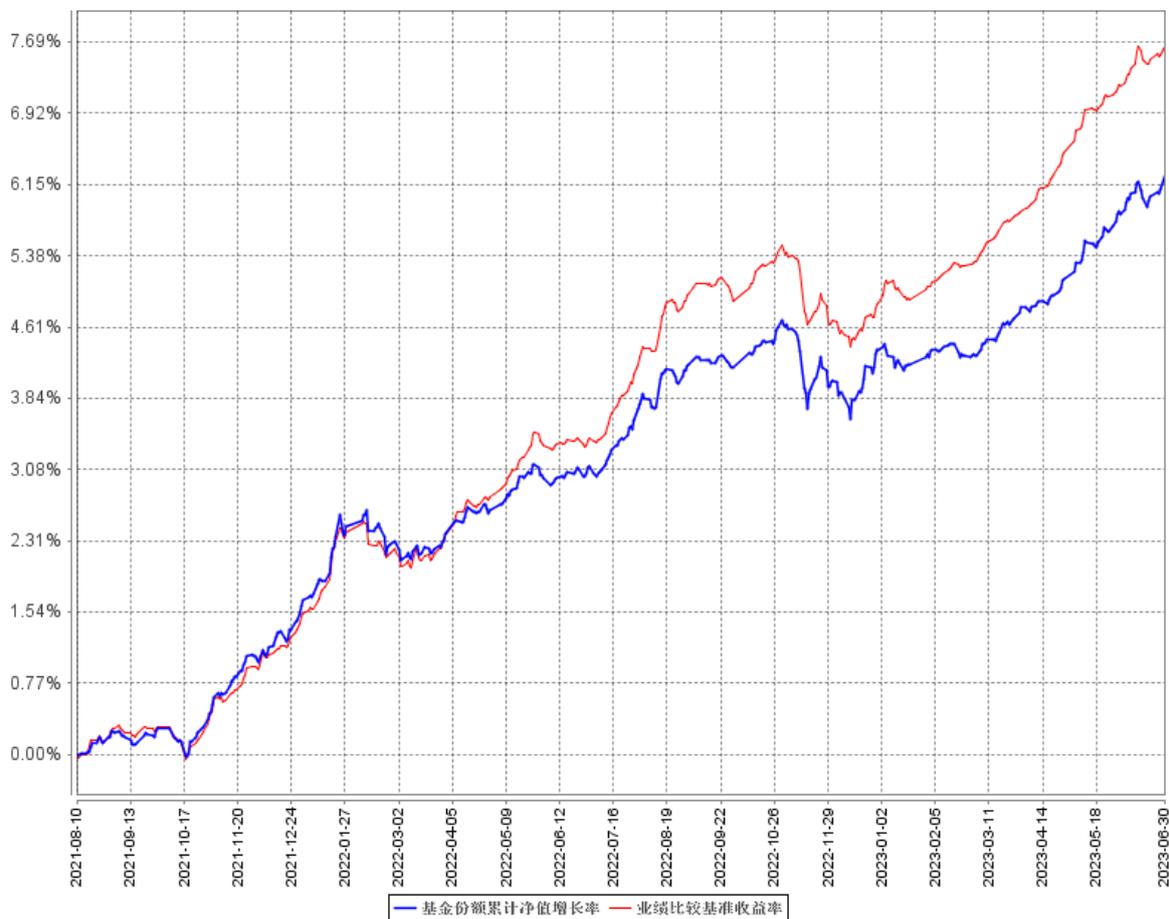
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.39% | 0.05% | 0.42% | 0.05% | -0.03% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.35% | 0.04% | 1.67% | 0.04% | -0.32% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.80% | 0.04% | 2.64% | 0.04% | -0.84% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.05% | 0.06% | 4.12% | 0.05% | -1.07% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.24% | 0.06% | 7.64% | 0.05% | -1.40% | 0.01% |

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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 | | |
| 李杨 | 本基金的基金经理 | 2021年8月13日 | - | 6年 | 天津财经大学经济学学士。2011年10月到2014年4月，在包商银行股份有限公司任债券交易员，2014年5月到2016年8月，在天津银行股份有限公司任债券交易员，2016年9月至今，在渤海汇金证券资产管理有限公司任基金经理。2017年8月至2021年8月任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2017年12月至2022年1月任渤海汇金汇增利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经 |

| | | | | | |
|-----|----------|-----------------|---|-----|---|
| | | | | | 理。2017 年 12 月至 2023 年 6 月担任渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 2 月至 2022 年 12 月担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2020 年 11 月起担任渤海汇金汇裕 87 个月定开基金基金经理。2021 年 8 月起任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 6 月起任渤海汇金兴宸一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 2 月起任渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
| 高延龙 | 本基金的基金经理 | 2021 年 8 月 10 日 | - | 3 年 | 墨尔本大学金融学硕士，特许金融分析师(CFA)，2013 年 3 月至 2015 年 3 月就职于联合资信评估有限公司，任分析师。2015 年 3 月至 2016 年 1 月就职于国开城市交通投资发展基金，任投资经理。2016 年 2 月至 2020 年 3 月就职于渤海人寿保险股份有限公司，任债券投资经理。2020 年 3 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，2020 年 6 月起任渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 8 月至 2022 年 1 月任汇添金货币市场基金基金经理。2020 年 11 月起担任渤海汇金汇裕 87 个月定开基金基金经理。2021 年 8 月起任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 发起式证券投资基金基金经理。2022 年 6 月起任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

上半年债市走出一波小牛市，各关键期限收益率下行幅度均在 20bps 左右。分品种看，指标

10 年国债下行 18bps，1-3 年国开下行 14-17bps，5-10 年国开下行 20-25bps。从时间段看，以 3 月上旬为分水岭，年初至 3 月初为收益小幅上行阶段，1-3 年品种收益上行幅度在 25bps 左右，5 年及以上品种收益上行 10bps 左右，主要影响因素包括疫情后市场对经济修复较为乐观，金融数据开门红，以及资金面较去年的显著宽松转为边际收敛。从 3 月上旬至半年末，交易主线由“强预期”切换到“弱现实”，经济修复内生动能不足，在一季度补偿性效应消退后，二季度主要数据均出现环比走弱，这是债券收益下行的基础因素。资金面看，一次降准一次降息，资金面重回宽松，机构套息策略运用增多，银行间回购余额攀升至 7-8 万亿水平。在此阶段，收益率走出一波较为流畅的下行，10 年国债收益在 6 月中旬下行至上半年低点 2.60% 附近。6 月下旬开始，市场对稳增长增量政策抱有一定预期，收益小幅回升。报告期内主要配置了中短端政金债，根据市场情况进行久期调节。阶段性参与长端债券的交易，博取价差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0110 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.80%，业绩比较基准收益率为 2.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度来看，预计收益率仍将在趋势交易和政策博弈之间反复横跳，一方面是新旧动能转换下收益率下台阶（中长期影响），一方面是稳增长增量政策预期（短期和交易情绪影响），预计 10 年国债收益将围绕 MLF 利率窄幅波动，如果基本面持续低迷、货币政策再发力，不排除挑战前低 2.5% 的可能性。在季度内中性偏乐观的基调下，如果收益出现显著回调，可以参与波段交易机会。品种选择上，由于广义基金账户对静态收益的追求，使得政金债和国债利差压缩，各关键期限利差为 10-15bps 左右，目前政金债收益水平基本接近或者到达了 6 月中旬的低点，但除超长国债品种之外的其他期限国债还有 3-5bps 的差距，所以可以重点关注国债品种。

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历。公募投资部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业

务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金进行了 1 次分红。以 2023 年 6 月 19 日为收益分配基准日，可供分配利润为 15,743,874.94 元，2023 年 6 月 26 日进行权益登记、除息，2023 年 6 月 27 日向渤海汇金兴荣一年定期开放债券基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.230 元。本基金的收益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

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 713,292.74 | 440,126.77 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 647,169,532.86 | 607,511,815.34 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 647,169,532.86 | 607,511,815.34 |
| 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 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 647,882,825.60 | 607,951,942.11 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 132,010,671.98 | 89,514,585.21 |
| 应付清算款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 129,362.82 | 131,514.52 |
| 应付托管费 | | 43,120.95 | 43,838.20 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 113,246.21 | 179,994.68 |
| 负债合计 | | 132,296,401.96 | 89,869,932.61 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 509,999,500.00 | 509,999,500.00 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 5,586,923.64 | 8,082,509.50 |
| 净资产合计 | | 515,586,423.64 | 518,082,009.50 |
| 负债和净资产总计 | | 647,882,825.60 | 607,951,942.11 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0110 元，基金份额总额 509,999,500.00 份。

6.2 利润表

会计主体：渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 11,579,944.27 | 9,404,313.51 |
| 1.利息收入 | | 2,766.84 | 14,186.88 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 1,248.00 | 912.08 |
| 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 | | 1,518.84 | 13,274.80 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 9,905,677.89 | 10,797,884.52 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 9,905,677.89 | 10,797,884.52 |
| 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 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 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 | 1,671,499.54 | -1,407,757.89 |
| 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 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 2,345,541.63 | 2,195,900.56 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 774,471.94 | 767,820.01 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 258,157.36 | 255,940.03 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 1,217,165.01 | 1,075,707.97 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,217,165.01 | 1,075,707.97 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 95,747.32 | 96,432.55 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 9,234,402.64 | 7,208,412.95 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 9,234,402.64 | 7,208,412.95 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 9,234,402.64 | 7,208,412.95 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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） | 509,999,500.00 | - | 8,082,509.50 | 518,082,009.50 |
| 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） | 509,999,500.00 | - | 8,082,509.50 | 518,082,009.50 |

| | | | | |
|--|--|--------|----------------|----------------|
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | - | - | -2,495,585.86 | -2,495,585.86 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 9,234,402.64 | 9,234,402.64 |
| (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) | - | - | - | - |
| 其中: 1.基金申购款 | - | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - | - |
| (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) | - | - | -11,729,988.50 | -11,729,988.50 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 (基金净值) | 509,999,500.00 | - | 5,586,923.64 | 515,586,423.64 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 (基金净值) | 509,999,500.00 | - | 8,519,001.42 | 518,518,501.42 |
| 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) | 509,999,500.00 | - | 8,519,001.42 | 518,518,501.42 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | - | - | -6,765,573.35 | -6,765,573.35 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 7,208,412.95 | 7,208,412.95 |
| (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) | - | - | - | - |
| 其中: 1.基金申购款 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|----------------|---|----------------|----------------|
| 2.基金赎回款 | - | - | - | - |
| (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） | - | - | -13,973,986.30 | -13,973,986.30 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 509,999,500.00 | - | 1,753,428.07 | 511,752,928.07 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| _____ 麻众志 _____ | _____ 边燕萍 _____ | _____ 刘云鹏 _____ |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可（2020）3106号《关于准予渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币509,999,500.00元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0585号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2021年8月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为509,999,500.00份基金份额，其中认购资金利息折合0.00份基金份额。本基金的基金管理人为渤海汇金证券资产管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、政府支持机构债券、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期

货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不投资于股票;也不投资于可转换债券、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%,但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期前 1 个月、开放期及开放期结束后 1 个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。在开放期内每个交易日日终,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内,本基金不受上述 5% 的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率。

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—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 713, 292. 74 |
| 等于：本金 | 713, 214. 57 |
| 加：应计利息 | 78. 17 |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计： | 713,292.74 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | | |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|----------------|------------|
| | 成本 | 应计利息 | 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 | 638,464,695.28 | 8,270,532.86 | 647,169,532.86 | 434,304.72 |
| | 合计 | 638,464,695.28 | 8,270,532.86 | 647,169,532.86 | 434,304.72 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 638,464,695.28 | 8,270,532.86 | 647,169,532.86 | 434,304.72 | |

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 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 29,562.45 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 29,562.45 |
| - | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 83,683.76 |
| 合计 | 113,246.21 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | 509,999,500.00 | 509,999,500.00 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 509,999,500.00 | 509,999,500.00 |

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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

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 | 9,319,704.32 | -1,237,194.82 | 8,082,509.50 |
| 本期利润 | 7,562,903.10 | 1,671,499.54 | 9,234,402.64 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |

| | | | |
|----------|----------------|------------|----------------|
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -11,729,988.50 | - | -11,729,988.50 |
| 本期末 | 5,152,618.92 | 434,304.72 | 5,586,923.64 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 1,248.00 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 1,248.00 |

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

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

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 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 9,401,757.82 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 503,920.07 |
| 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 | 9,905,677.89 |

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 | 806,263,079.61 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 795,644,281.57 |
| 减：应计利息总额 | 10,097,777.97 |
| 减：交易费用 | 17,100.00 |
| 买卖债券差价收入 | 503,920.07 |

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

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

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 | 1,671,499.54 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 1,671,499.54 |
| ——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 | 1,671,499.54 |

6.4.7.21 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

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 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用 | 14,876.39 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 2,763.56 |
| 银行间账户维护费 | 18,600.00 |
| 其他费用 | - |
| 合计 | 95,747.32 |

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 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 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 |

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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

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 2023年1月1日至2023年6月 30日 | 上年度可比期间 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 | 774,471.94 | 767,820.01 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注：支付基金管理人渤海汇金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.3% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 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 | 258,157.36 | 255,940.03 |
|----------------|------------|------------|

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

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8月10日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份 | - | - |

| | | |
|---------------------|---------------|---------------|
| 额 | | |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.96% | 1.96% |

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 |
| 兴业银行 | 713,214.57 | 1,248.00 | 661,617.67 | 14,186.88 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|-----|------------|-------------|---------------|-----------|---------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2023年6月26日 | - | 2023年6月26日 | 0.230 | 11,729,988.50 | - | 11,729,988.50 | |
| 合计 | - | - | - | 0.230 | 11,729,988.50 | - | 11,729,988.50 | |

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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 132,010,671.98 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|--------|----------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 200203 | 20 国开 03 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.99 | 247,000 | 25,439,044.30 |
| 220202 | 22 国开 02 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.29 | 800,000 | 81,032,087.43 |
| 190203 | 19 国开 03 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.06 | 300,000 | 30,616,849.32 |
| 合计 | | | | 1,347,000 | 137,087,981.05 |

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

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

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

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

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

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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 19,612,000.00 | 19,691,563.29 |
| 合计 | 19,612,000.00 | 19,691,563.29 |

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，同业存单无债项评级。

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 30,198,000.00 | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 589,089,000.00 | 587,820,252.05 |
| 合计 | 619,287,000.00 | 587,820,252.05 |

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

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。

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%。在开放期内，本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 40%；在封闭期内，本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 100%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 年6 月30 日 | 6个月以内 | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------------|---------------|---------------|----------------|---------------|-----|----------------|
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 713,292.74 | - | - | - | - | 713,292.74 |
| 交易性金融资产 | 19,936,309.10 | 30,616,849.32 | 522,753,603.66 | 73,862,770.78 | - | 647,169,532.86 |
| 资产 | 20,649,601.84 | 30,616,849.32 | 522,753,603.66 | 73,862,770.78 | - | 647,882,825.60 |

| | | | | | | |
|---------------------------------------|-----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 总计 | | | | | | |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出 回购 金融 资产 款 | 132,010,671.98 | - | - | - | - | 132,010,671.98 |
| 应付 管理 人报 酬 | - | - | - | - | 129,362.82 | 129,362.82 |
| 应付 托管 费 | - | - | - | - | 43,120.95 | 43,120.95 |
| 其他 负债 | - | - | - | - | 113,246.21 | 113,246.21 |
| 负债 总计 | 132,010,671.98 | - | - | - | 285,729.98 | 132,296,401.96 |
| 利率 敏感 度缺 口 | -111,361,070.14 | 30,616,849.32 | 522,753,603.66 | 73,862,770.78 | -285,729.98 | 515,586,423.64 |
| 上年 度末 2022 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 | 440,078.65 | - | - | - | 48.12 | 440,126.77 |
| 交易 性金 融资 产 | - | -69,806,000.00 | 525,157,000.00 | - | -12,548,815.34 | 607,511,815.34 |
| 其他 资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产 总计 | 440,078.65 | -69,806,000.00 | 525,157,000.00 | - | -12,548,863.46 | 607,951,942.11 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出 回购 金融 资产 | 89,499,745.75 | - | - | - | 14,839.46 | 89,514,585.21 |

| | | | | | | |
|---------|----------------|---------------|----------------|---|----------------|----------------|
| 款 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 131,514.52 | 131,514.52 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 43,838.20 | 43,838.20 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 179,994.68 | 179,994.68 |
| 负债总计 | 89,499,745.75 | - | - | - | 370,186.86 | 89,869,932.61 |
| 利率敏感度缺口 | -89,059,667.10 | 69,806,000.00 | 525,157,000.00 | - | -12,178,676.60 | 518,082,009.50 |

6.4.13.4.1.2 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（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| | 1. 市场利率上升 25 个基点 | -2,658,435.98 | -2,451,108.73 |
| 2. 市场利率下降 25 个基点 | 2,578,964.25 | 2,462,828.86 | |

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 647,169,532.86 | 607,511,815.34 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 647,169,532.86 | 607,511,815.34 |

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 647,169,532.86 | 99.89 |
| | 其中：债券 | 647,169,532.86 | 99.89 |
| | 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 | 713,292.74 | 0.11 |
| 8 | 其他各项资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 647,882,825.60 | 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期内未持有股票。

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

注：本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未持有股票。

7.5 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 | 70,798,692.62 | 13.73 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 556,434,531.14 | 107.92 |
| | 其中：政策性金融债 | 526,063,940.98 | 102.03 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 19,936,309.10 | 3.87 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 647,169,532.86 | 125.52 |

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

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 | 220202 | 22 国开 02 | 800,000 | 81,032,087.43 | 15.72 |
| 2 | 150405 | 15 农发 05 | 500,000 | 51,984,356.16 | 10.08 |
| 3 | 220303 | 22 进出 03 | 500,000 | 50,308,729.51 | 9.76 |
| 4 | 180210 | 18 国开 10 | 300,000 | 33,154,397.26 | 6.43 |
| 5 | 190409 | 19 农发 09 | 300,000 | 31,205,827.40 | 6.05 |

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

无

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

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

无。

7.11.2 本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况

无。

7.11.3 期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无

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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

注：无

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 | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|---------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,000.00 | 1.96 | 10,000,000.00 | 1.96 | 自合同生效之日起不少于三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | 1.96 | 10,000,000.00 | 1.96 | 自合同生效之日起不少于三年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2021年8月10日）基金份额总额 | 509,999,500.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 509,999,500.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - |
| 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 | 509,999,500.00 |

§ 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。

本基金基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

自 2023 年 4 月 11 日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

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 | |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 渤海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

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

2、交易单元的选择标准和程序

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

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

3、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 |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 渤海汇金兴荣一年定期开放债券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 |
| 2 | 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 | 上海证券报 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 3 | 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、上海证券报 | 2023 年 3 月 9 日 |
| 4 | 渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年年度报告 | 公司网站 | 2023 年 3 月 31 日 |
| 5 | 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 | 上海证券报 | 2023 年 3 月 31 日 |
| 6 | 渤海汇金兴荣一年定期开放债券 | 公司网站 | 2023 年 4 月 22 日 |

| | | | |
|----|--|------------|-----------------|
| | 型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | | |
| 7 | 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 | 上海证券报 | 2023 年 4 月 23 日 |
| 8 | 渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(2023 年第 1 号) | 公司网站 | 2023 年 5 月 13 日 |
| 9 | 渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要(更新) | 公司网站 | 2023 年 5 月 13 日 |
| 10 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新提示性公告 | 上海证券报 | 2023 年 5 月 13 日 |
| 11 | 渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告 | 公司网站、上海证券报 | 2023 年 6 月 26 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 | 499,999,500.00 | 0.00 | 0.00 | 499,999,500.00 | 98.04% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。由此可能导致的特有风险主要包括：

1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。
2. 单一大额投资者大额赎回时为应对赎回证券变现产生的冲击成本的风险。
3. 单一大额投资者退出后，可能出现迷你基金的情形，可能影响投资目标的实现。
4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。

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兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件；

2、《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

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

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