

渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 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

报告送出日期:2026 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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2026年03月27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2025年01月01日起至2025年12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
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	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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63

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	63
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	63
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	63
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	63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	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情况	65
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	66
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	68
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§ 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	
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 03 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	40,356,026.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	渤海汇金新动能主题混合 A	渤海汇金新动能主题混合 C
下属分级基金的交易代码	010584	021364
报告期末下属分级基金的份额总额	27,504,050.26 份	12,851,976.24 份

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>

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；

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。

	<p>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。</p> <p>(四) 债券投资策略</p> <p>本基金在保障流动性的基础上，有效利用基金资产进行债券投资，以提高基金资产的投资收益。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(五) 股指期货、国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(六) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济等多个因素的研究预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时在严格控制风险的情况下，综合运用多个策略和研究方法，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p>
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	吴国威	王秀荣
	联系电话	022-23861655	0531-68889484
	电子邮箱	liujia@bhhjamc.com	wangxr01@zts.com.cn
客户服务电话		400-651-1717	95538
传真		022-23861651	0531-68889445
注册地址		深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号基金小镇对冲基金中心 506	济南市高新区经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼
办公地址		深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号基金小镇对冲基金中心 506	山东省济南市经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼 35 层
邮政编码		518054	250101
法定代表人		齐朝晖	王洪

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.bhhjamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年		2024 年		2023 年	
	渤海汇金新	渤海汇金新	渤海汇金新	渤海汇金新	渤海汇金新	渤海汇金新

	动能主题混 合 A	动能主题混 合 C	动能主题混 合 A	动能主题混 合 C	动能主题混 合 A	动能主题混 合 C
本期已实现 收益	15,715,700 .48	3,910,761. 18	-4,311,795 .19	-1,299.45	2,867,738. 66	-
本期利润	18,133,803 .44	1,378,419. 90	-4,864,423 .76	-161,322.0 7	5,156,453. 01	-
加权平均基 金份额本期 利润	0.4549	0.1492	-0.1421	-0.1479	0.1599	-
本期加权平 均净值利润 率	43.04%	12.74%	-18.72%	-16.78%	18.35%	-
本期基金份 额净值增长 率	52.49%	51.72%	-6.02%	-5.66%	21.88%	-
3.1.2 期末 数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分 配利润	7,621,039. 13	3,487,185. 15	-6,013,881 .95	-563,034.2 9	-5,455,172 .17	-
期末可供分 配基金份额 利润	0.2771	0.2713	-0.1625	-0.1621	-0.1089	-
期末基金资 产净值	35,125,089 .39	16,339,161 .39	30,994,590 .65	2,909,998. 51	44,641,753 .40	-
期末基金份 额净值	1.2771	1.2713	0.8375	0.8379	0.8911	-
3.1.3 累计 期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累 计净值增长 率	27.71%	43.13%	-16.25%	-5.66%	-10.89%	-

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、为降低迷你基金投资者负担，我司决定自 2024 年 5 月 16 日(含)起，由公司承担本基金迷你期间的相关固定费用（包括：信息披露费、审计费、基金份额持有人大会费、银行间账户维护费、注册登记费等）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

渤海汇金新动能主题混合 A 净值表现

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	7.68%	1.32%	-0.69%	1.38%	8.37%	-0.06%
过去六个月	18.92%	1.24%	32.43%	1.40%	-13.51%	-0.16%
过去一年	52.49%	1.55%	36.93%	1.26%	15.56%	0.29%
过去三年	74.68%	1.82%	20.41%	1.19%	54.27%	0.63%
自基金合同生效起至今	27.71%	1.65%	1.26%	1.16%	26.45%	0.49%

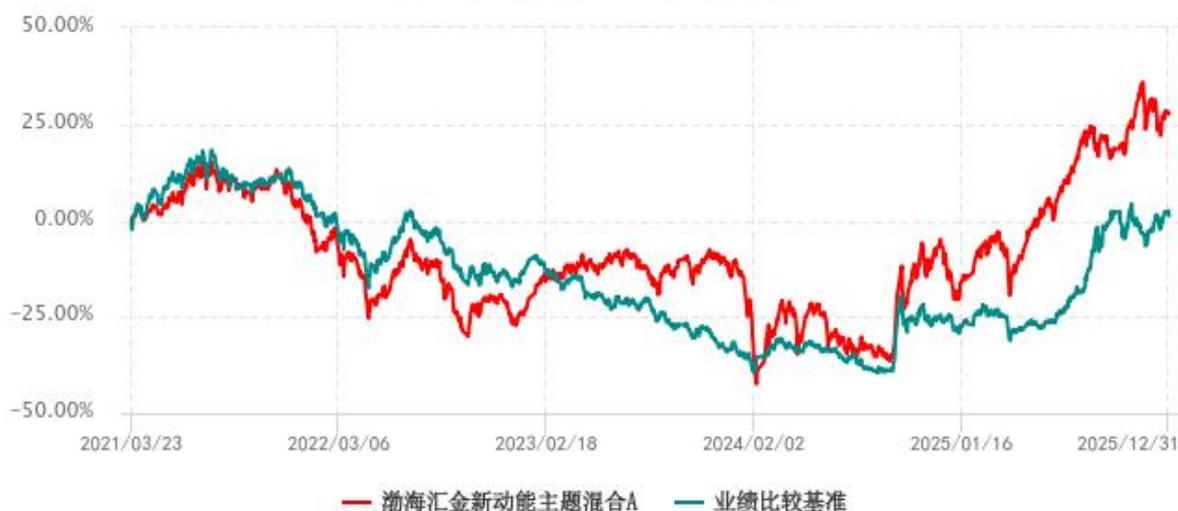
渤海汇金新动能主题混合 C 净值表现

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	7.54%	1.32%	-0.69%	1.38%	8.23%	-0.06%
过去六个月	18.61%	1.24%	32.43%	1.40%	-13.82%	-0.16%
过去一年	51.72%	1.55%	36.93%	1.26%	14.79%	0.29%
自基金合同生效起至今	43.13%	1.59%	37.16%	1.23%	5.97%	0.36%

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

渤海汇金新动能主题混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年03月23日-2025年12月31日)



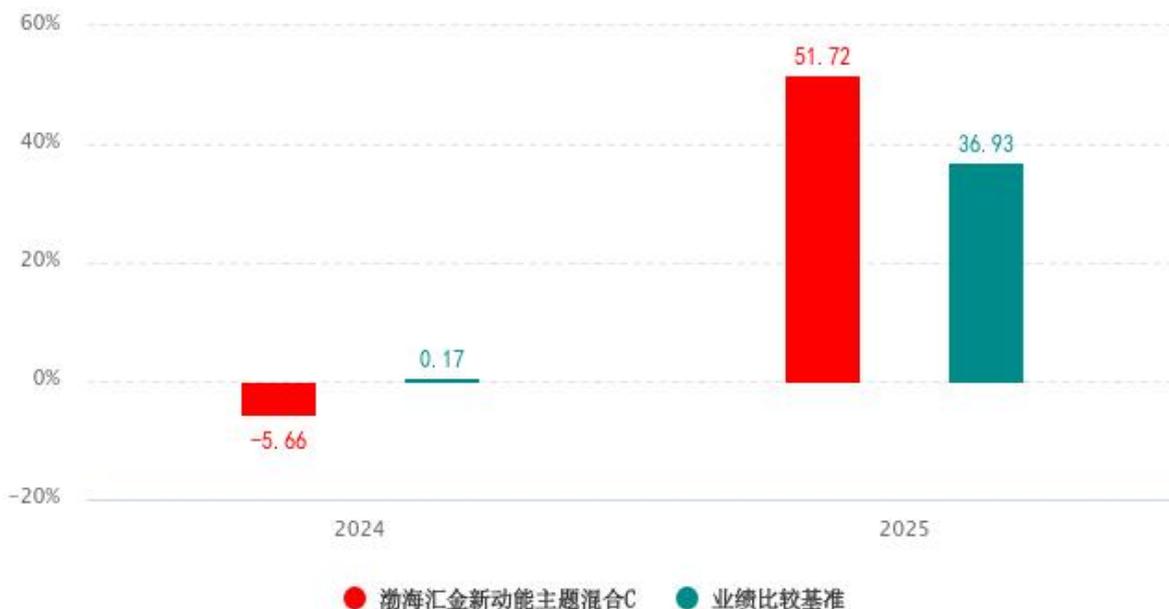
渤海汇金新动能主题混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年11月28日-2025年12月31日)



- 注：1、本基金合同于 2021 年 3 月 23 日生效。
 2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。
 3、经与托管人协商一致，管理人决定自 2024 年 11 月 27 日起增设 C 类份额。C 类份额自首笔份额登记日（即 2024 年 11 月 28 日）起披露业绩数据。

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 03 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。

C 类份额自首笔份额登记日（即 2024 年 11 月 28 日）起披露业绩数据，首笔份额登记当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 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 2025 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 18 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）、渤海汇金优选进取 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、渤海汇金优选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金、渤海汇金 2 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、渤海汇金优选价值混合型发起式证券投资基金、渤海汇金 1 个月持有期债券型发起式证券投资基金、渤海汇金鑫泉平衡混合型发起式证券投资基金、渤海汇金中证全指自由现金流指数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	公募量化权益部总经理兼公募权益部量化投资团队负责人、量化投资总监，本基金基金经理	2021-03-23	-	21 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。现任公募量化权益部总经理兼公募权益部量化投资团队负责人、量化投资总监。2017 年 7 月至 2018 年 12 月担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2018 年 2 月至 2022 年 12 月担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2018 年 7 月至 2022 年 11 月担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。2021 年 3 月起担任渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月至 2024 年 12 月担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、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对指令进行综合平衡，保证交易在各资产组合间的公平执行，保证各类投资人得到公平对待，并通过恒生 O32 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2.1 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，本基金未发生异常交易行为，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券交易当日成交量的 5% 的情形。

4.4 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

回顾 2025 年，A 股市场呈现强势表现，市场中枢持续抬升，上证指数创出十年新高。市场行情的背后是国内外环境深刻变化的持续演绎。一是去年 924 宏观政策转向，叠加中国在国际竞争中赢得战略主动，令全球投资者重新认识中国经济的韧性。二是中国在人工智能、航空航天、创新药等领域的科技叙事，促使中国创新能力被重新评估。三是在美联储进入降息周期，美元信用主导地位削弱开启全球货币秩序重构背景下，全球资本再平衡促使外资加速流入中国。四是资本市场改革持续深化，深刻改变 A 股市场生态。制度护航、产业突破及国际环境变化形成合力，推动了 2025 年中国资产价值重估。市场的显著特征是科技成长驱动的结构牛市行情。在增量资金推动下，市场活跃度持续攀升。截至 2025 年 12 月 31 日，2025 年上证指数上涨 18.41%、沪深 300 上涨 17.66%、创业板指上涨 49.57%、中证 500 上涨 30.39%、中证 1000 上涨 27.49%、中证 2000 上涨 36.42%。行业方面，全年表现较好的行业是有色金属、通信、电子、综合、电力设备，表现较弱的行业分别是食品饮料、煤炭、美容护理、公用事业、交通运输。

2025 年，新动能基金坚持新动能主题方向下的量化小微盘策略。全年来看，在流动性宽松、市场风险偏好回升、政策呵护的驱动下，小微盘风格整体表现强势，呈现较好的收益弹性。同时我们始终致力于量化小微盘策略的优化迭代，持续赋能策略组合超额收益的提升，努力实现基金资产净值增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末渤海汇金新动能主题混合 A 基金份额净值为 1.2771 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 52.49%，同期业绩比较基准收益率为 36.93%；截至报告期末渤海汇金新动能主题混合 C 基金份额净值为 1.2713 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 51.72%，同期业绩比较基准收益率为 36.93%。

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 2026 年，宏观流动性仍将保持充裕，险资、基金等中长期资金及居民存款等潜在资金对股市资金面形成有力支撑。2026 年是“十五五”规划开局之年，政策基调仍偏积极，政策环境对风险资产较为友好。产业供需进一步改善、AI 产业应用持续推进以及企业出海延续良好趋势有望驱动企业盈利增速回升。海外环境看，弱美元格局下全球宽松流动性环境延续，美国中期选举和美联储换届或将对全球风险偏好及流动性带来阶段性扰动。综合来看，我们认为在科技成长引领下预计 2026 年市场整体仍将呈现震荡上行态势，不同板块、风格轮动，皆有可为。同时，伴随市场估值持续提升及复杂多变海外环境，未来市场或将呈现更高的波动性。

2026 年新动能基金仍将坚持新动能主题下的量化小微盘策略，积极把握小微盘风格在宽松流动性环境下呈现的结构机会。尽管短期风格层面波动面临较大不确定性，小微盘风格本身亦具有更高的波动特征，但这并不是我们小微盘策略长期收益表现的核心因素。我们仍将坚持长期投资视角，持续专注于在小微盘策略上打磨、精进，更好地发挥量化策略在改善组合表现上的积极作用，提升

策略的适应性与锐度，进一步巩固策略长期收益优势。用长期确定性抚平短期波动的喧嚣，力争为投资者创造更好的长期投资回报。

接下来分享一下自己关于投资以及量化投资的一点点思考。可能大家日常都会更关注于市场热点的切换，大小盘风格的轮动，什么时候市场风险更大或是机会更多，而我想这些并非我自己关注于投资的要点。要说市场，我当然是继续看好 A 股未来的表现，但这主观看法并不是我们策略表现的决定因素。我们建立量化策略的基础逻辑是基于市场的微观结构，而非宏观叙事，宏观叙事易变，微观结构难改。如果对市场保持足够的敬畏和充分的理解，就不会简单选择押大还是押小，而是在策略的构建逻辑中努力学会让概率站在自己这边，即便一两次的失败也只是战术上的牺牲，并不会影响战略上的大局，无论价值投资还是量化投资，我想都应如此。所以，作为量化基金经理，我主观对市场的看法不应成为影响我们策略组合的主要因素，不然我们的量化策略在我看来就不算是一个好的纯粹的策略，量化策略的研发端可以是火热的，但量化策略的执行端应当是冰冷的。以数据为本源的客观性和严格的投资纪律性是量化投资的最大优势，这样的优势更应坚定的保持才会有所收获。

那么投资策略的好坏，也只有从更长期去评价，无需太在意短期一城一池之得失。过度放大眼前波动，并且将市场表现和宏观叙事线性外推，然后追涨杀跌，是很多投资者甚至基金持有人无法在市场和基金投资中获益的主要原因。我们不能否认一些短期交易者的过人之处，但于大众而言，借鉴的意义太低，学习的成本和代价都过大，因此价值投资总会被更多人推崇。做简单的事情，往往可以让事情变得更简单。

对于量化投资，大众也不应持续带着有色滤镜，量化投资也并不完全等同于程序化交易和高频交易，广义上说仅仅只是借助数理统计的工具方法或者思路逻辑而已，其实很多主观投资者也会借助到量化的工具和思路，就好像现在生活里面总需要 AI 的辅助，而 AI 本身不是魔鬼，关键在于使用的人是何目的和初衷。

当然量化投资本身也有其局限性，基于历史数据的归纳较多，对未来的推演较少，容易出现过拟合。万物皆无完美，但我们可以包容不完美，利用不完美。大部分量化投资其实也主导不了市场的方向，好的量化投资则更利于市场价格的发现，正如幻方梁文锋在其过往某次演讲中说的，量化投资其实会有利于提升市场的有效性，就像我们在某些成熟海外市场看到的那样。

至于本基金，我们坚持用主要针对小市值企业的量化小微盘策略去运作，也是努力在市场微观生态结构中去分享到一些 A 股市场中小企业阶段成长的收益，其实在我们自己的量化投研体系中也有其他不同风格且自认为还不错的策略，但对于这只基金我们依然会保持风格上的坚持，而不会依个人对风格变化的主观看法去改变产品组合本身的风格特征。至于针对市场风格的变化，也是在量化范畴内可以适度解决的课题，这方面好的策略我们会留待未来管理的不同类型基金产品中去实现。现有的量化策略经过持续优化迭代之后我还是有信心期待未来更好的长期表现，当然我们也不会满足于，希望能努力用更好的长期业绩回报投资者长期的信任陪伴。

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，对公司经营管理、基金运作和证券资产管理的各项业务环节进行审计监督，协助公司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。

公司稽核工作接受公司党总支和董事会的领导和监督。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，完成多个评估、稽核项目，包括合规管理有效性评估、全面风险管理评估、公募投资条线常规稽核、信息技术管理审计等多个稽核项目。

报告期内，公司监察稽核工作整体平稳开展，根据监管变化和基金业务开展情况，适时调整工作安排，提高监察稽核工作质量，明确监察稽核各业务环节工作职责，规范稽核工作程序，加强对公司各业务条线、各部门的审计和整改督促。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，协助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、分管公募基金业务的管理人员、合规总监、首席风险官、财务负责人、公募投资部门负责人、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

报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况。本基金自 2022 年 6 月 23 日至 2025 年 3 月 16 日连续 661 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人已向中国证监会报告，鉴于本基金的运作情况，基金管理人的解决方案为：将不断完善已有持营方案，加大对本基金的持续营销。本基金自 2025 年 3 月 18 日至 2025 年 5 月 7 日连续 33 个工作日，2025 年 5 月 13 日至 2025 年 7 月 8 日连续 40 个工作日，以及 2025 年 9 月 19 日至 2025 年 11 月 4

日连续 27 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。

§ 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(26)第 P03271 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“新动能”)的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及报表附注。</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、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)以及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</p>

	定编制，公允反映了新动能 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于新动能，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>渤海汇金证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括新动能 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
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、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)以及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新动能的持续经营能力，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新动能、终止运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新动能的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	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>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，就可能导致对新动能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新动能不能持续经营。</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	杨小真 王亚坤
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
审计报告日期	2026-03-25

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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	3,784,777.74	2,519,086.48
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	48,571,894.98	31,501,622.72
其中：股票投资		48,571,894.98	31,501,622.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		99,363.52	2,626.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		52,456,036.24	34,023,335.84
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		906,171.41	77,257.51
应付管理人报酬		64,500.07	32,940.20
应付托管费		10,750.03	5,490.02
应付销售服务费		10,363.95	457.27
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	7.4.7.6	-	2,601.68
负债合计		991,785.46	118,746.68
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	40,356,026.50	40,481,505.40

未分配利润	7.4.7.8	11,108,224.28	-6,576,916.24
净资产合计		51,464,250.78	33,904,589.16
负债和净资产总计		52,456,036.24	34,023,335.84

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 40,356,026.50 份。其中渤海汇金新动能主题混合 A 基金份额净值 1.2771 元，基金份额总额 27,504,050.26 份；渤海汇金新动能主题混合 C 基金份额净值 1.2713 元，基金份额总额 12,851,976.24 份。

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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		20,298,235.04	-4,658,847.46
1. 利息收入		13,111.26	5,440.16
其中：存款利息收入	7.4.7.9	13,111.26	5,440.16
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,954,911.01	-4,108,449.83
其中：股票投资收益	7.4.7.10	19,653,034.86	-4,354,978.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	654.13
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	301,876.15	245,874.80
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-114,238.32	-712,651.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	444,451.09	156,813.40
减：二、营业总支出		786,011.70	366,898.37
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	628,945.69	311,860.69
2. 托管费	7.4.10.2.2	104,824.26	51,976.73
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	52,241.75	457.27
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	-	2,603.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,512,223.34	-5,025,745.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,512,223.34	-5,025,745.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19,512,223.34	-5,025,745.83

7.3 净资产变动表

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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	40,481,505.40	-6,576,916.24	33,904,589.16
二、本期期初净资产	40,481,505.40	-6,576,916.24	33,904,589.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-125,478.90	17,685,140.52	17,559,661.62
（一）、综合收益总额	-	19,512,223.34	19,512,223.34
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-125,478.90	-1,827,082.82	-1,952,561.72
其中：1. 基金申购款	107,866,748.04	19,085,018.49	126,951,766.53
2. 基金赎回款	-107,992,226.94	-20,912,101.31	-128,904,328.25
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	40,356,026.50	11,108,224.28	51,464,250.78
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	50,096,925.57	-5,455,172.17	44,641,753.40
二、本期期初净资产	50,096,925.57	-5,455,172.17	44,641,753.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9,615,420.17	-1,121,744.07	-10,737,164.24
（一）、综合收益总额	-	-5,025,745.83	-5,025,745.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-9,615,420.17	3,904,001.76	-5,711,418.41
其中：1. 基金申购款	29,056,016.99	-4,951,543.84	24,104,473.15
2. 基金赎回款	-38,671,437.16	8,855,545.60	-29,815,891.56

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	40,481,505.40	-6,576,916.24	33,904,589.16

注：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：

吴国威	边燕萍	宁晓明
-----	-----	-----
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(以下简称“中国证监会”)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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产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

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付,且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对

该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费

后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

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或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

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 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) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型

进行估值。

(2)对于证券交易所上市的股票,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,根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566号)所规定的固定收益品种,本基金按照相关规定,对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值;对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[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[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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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股票、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)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(4)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	3,784,777.74	2,519,086.48
等于：本金	3,784,318.59	2,518,906.95
加：应计利息	459.15	179.53

减：坏账准备	-	-
合计	3,784,777.74	2,519,086.48

注：其他存款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 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	48,641,952.46	-	48,571,894.98	-70,057.48
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	48,641,952.46	-	48,571,894.98	-70,057.48
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	31,457,441.88	-	31,501,622.72	44,180.84
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	31,457,441.88	-	31,501,622.72	44,180.84

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末无各项买入返售金融资产期末余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 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	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	-	2,601.68
合计	-	2,601.68

7.4.7.7 实收基金

渤海汇金新动能主题混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,008,472.60	37,008,472.60
本期申购	38,745,140.39	38,745,140.39
本期赎回（以“-”号填列）	-48,249,562.73	-48,249,562.73
本期末	27,504,050.26	27,504,050.26

渤海汇金新动能主题混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,473,032.80	3,473,032.80
本期申购	69,121,607.65	69,121,607.65
本期赎回（以“-”号填列）	-59,742,664.21	-59,742,664.21
本期末	12,851,976.24	12,851,976.24

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

渤海汇金新动能主题混合 A

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

上年度末	-3,626,461.21	-2,387,420.74	-6,013,881.95
本期期初	-3,626,461.21	-2,387,420.74	-6,013,881.95
本期利润	15,715,700.48	2,418,102.96	18,133,803.44
本期基金份额交易产生的变动数	-4,026,674.38	-472,207.98	-4,498,882.36
其中：基金申购款	2,666,164.32	37,674.44	2,703,838.76
基金赎回款	-6,692,838.70	-509,882.42	-7,202,721.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,062,564.89	-441,525.76	7,621,039.13

渤海汇金新动能主题混合 C

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
上年度末	-391,991.14	-171,043.15	-563,034.29
本期期初	-391,991.14	-171,043.15	-563,034.29
本期利润	3,910,761.18	-2,532,341.28	1,378,419.90
本期基金份额交易产生的变动数	-22,038.38	2,693,837.92	2,671,799.54
其中：基金申购款	12,269,905.59	4,111,274.14	16,381,179.73
基金赎回款	-12,291,943.97	-1,417,436.22	-13,709,380.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,496,731.66	-9,546.51	3,487,185.15

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	0.13	0.10
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	13,111.13	5,440.06
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	13,111.26	5,440.16

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	265,504,209.77	186,864,938.75
减：卖出股票成本总额	245,478,237.62	190,876,829.18
减：交易费用	372,937.29	343,088.33
买卖股票差价收入	19,653,034.86	-4,354,978.76

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	-	44.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	609.39
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	-	654.13

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	3,428.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	2,788.20
减：应计利息总额	-	31.17
减：交易费用	-	0.21
买卖债券差价收入	-	609.39

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	301,876.15	245,874.80
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	301,876.15	245,874.80

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-114,238.32	-712,651.19
——股票投资	-114,238.32	-712,246.49
——债券投资	-	-404.70
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——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	-114,238.32	-712,651.19

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	444,351.96	156,813.40
转换费收入	99.13	-
合计	444,451.09	156,813.40

7.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	-	2,601.68
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	-	2.00
合计	-	2,603.68

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大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、基金证券经纪商
渤海证券股份有限公司（“渤海证券”）	基金管理人的独资股东、基金销售机构、基金证券经纪商

注：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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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
中泰证券	3,563,348.93	0.67%	-	-
渤海证券	524,603,609.04	99.33%	369,560,331.39	100.00%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月 31日		上年度可比期间2024年01月01日 至2024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
中泰证券	-	-	2,265.54	66.68%
渤海证券	-	-	1,132.26	33.32%

7.4.10.1.4 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。

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2025年01月01日至2025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
中泰证券	1,389.77	0.67%	0.00	0.00%
渤海证券	204,668.95	99.33%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间2024年01月01日至2024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
中泰证券	0.14	0.00%	0.00	0.00%
渤海证券	225,952.70	100.00%	0.00	0.00%

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2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间2024年01月 01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理 费	628,945.69	311,860.69
其中：应支付销售机构的客户维 护费	219,277.31	141,678.67
应支付基金管理人的净 管理费	409,668.38	170,182.02

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	104,824.26	51,976.73

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	渤海汇金新动能主题混合 A	渤海汇金新动能主题混合 C	合计
渤海汇金资管	-	5.43	5.43
渤海证券	-	19,093.33	19,093.33
合计	-	19,098.76	19,098.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	渤海汇金新动能主题混合 A	渤海汇金新动能主题混合 C	合计
渤海汇金资管	-	0.15	0.15
渤海证券	-	425.66	425.66
合计	-	425.81	425.81

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给渤海汇金资管，再由渤海汇金资管计算并支付给各基金销售机构。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付

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：本基金本报告期内及上年度可比期间内无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：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方发生重大转融通证券出借业务。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方发生重大转融通证券出借业务。

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****渤海汇金新动能主题混合 A**

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
报告期初持有的基金份额	1,001,291.67	1,001,291.67
报告期间申购/买入总份额	14,205,644.02	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	8,042,941.00	-
报告期末持有的基金份额	7,163,994.69	1,001,291.67
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	26.05%	2.71%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金基金合同和招募说明书的规定执行。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	0.00	0.13	0.00	0.10
中泰证券-其他存款	496,395.21	788.67	1,210,937.00	2,189.36
渤海证券-其他存款	3,288,382.53	12,322.46	1,308,149.48	3,250.70

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中泰证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 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。

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（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
920641	格利尔	2025-12-31	筹划 控制 权变 动	18.34	2026-01-09	23.36	4,000	78,380.00	73,360.00	-

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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

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因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

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。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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司建立了以董事会承担全面风险管理的最终责任，以审计委员会承担全面风险管理的监督责任，以经营层承担全面风险管理的主要责任，以首席风险官负责全面风险管理工作，以风险管理委员会为风险管理工作指导机构，由各类型风险管理工作的主责部门为风险管理的归口管理部门，由各部门、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。公司应当赋予风险管理组织机构、人员足够的权限与资源，建立各部门、各分支机构、风险管理部门、内审部门之间密切协作、相互衔接、有效制衡的运行机制。

7.4.13.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理制度，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。

7.4.13.3 流动性风险

报告期内本基金组合资产的流动性风险分析本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

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，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。

截至本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

7.4.13.3.1 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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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。

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，此外还持有银行存款等利率敏感性资产，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 2025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						
货币资金	3,784,318.59	-	-	-	459.15	3,784,777.74
交易性金融资产	-	-	-	-	48,571,894.98	48,571,894.98
应收申购款	-	-	-	-	99,363.52	99,363.52
资产总计	3,784,318.59	-	-	-	48,671,717.65	52,456,036.24
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	906,171.41	906,171.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	64,500.07	64,500.07
应付托管费	-	-	-	-	10,750.03	10,750.03
应付销售服务费	-	-	-	-	10,363.95	10,363.95
负债总计	-	-	-	-	991,785.46	991,785.46
利率敏感度缺口	3,784,318.59	-	-	-	47,679,932.19	51,464,250.78
上年度末 2024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						
货币资金	2,518,906.95	-	-	-	179.53	2,519,086.48
交易性金融资产	-	-	-	-	31,501,622.72	31,501,622.72
应收申购款	-	-	-	-	2,626.64	2,626.64
资产总计	2,518,906.95	-	-	-	31,504,428.89	34,023,335.84
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	77,257.51	77,257.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	32,940.20	32,940.20
应付托管费	-	-	-	-	5,490.02	5,490.02
应付销售服务费	-	-	-	-	457.27	457.27
其他负债	-	-	-	-	2,601.68	2,601.68
负债总计	-	-	-	-	118,746.68	118,746.68
利率敏感度缺口	2,518,906.95	-	-	-	31,385,682.21	33,904,589.16

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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，因此无重大外汇风险。

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 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	48,571,894.98	94.38	31,501,622.72	92.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	48,571,894.98	94.38	31,501,622.72	92.91

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5； 2. 其他市场变量保持不变。		
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析	相关风险变量的变动	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,428,594.75	6,856,351.56
	2. 业绩比较基准下降 5%	-2,428,594.75	-6,856,351.56

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	48,498,534.98	31,501,622.72
第二层次	73,360.00	-
第三层次	-	-

合计	48,571,894.98	31,501,622.72
----	---------------	---------------

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 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。

7.4.14.4 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货币资金、应收申购款及应付款项等，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	48,571,894.98	92.60
	其中：股票	48,571,894.98	92.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,784,777.74	7.22
8	其他各项资产	99,363.52	0.19
9	合计	52,456,036.24	100.00

8.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,591,060.00	73.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	812,494.00	1.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,518,000.00	2.95
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,209,275.60	4.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	358,042.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	191,939.00	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	5,560,268.38	10.80
O	居民服务、修理和其他服务业	62,040.00	0.12
P	教育	101,283.00	0.20
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	167,493.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	48,571,894.98	94.38

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688565	力源科技	88,100	985,839.00	1.92
2	300246	宝莱特	120,900	979,290.00	1.90
3	603488	展鹏科技	120,800	942,240.00	1.83
4	688096	京源环保	116,200	917,980.00	1.78
5	002999	天禾股份	114,500	782,035.00	1.52
6	600303	曙光股份	238,800	778,488.00	1.51
7	002591	恒大高新	95,100	772,212.00	1.50
8	603023	威帝股份	152,600	767,578.00	1.49
9	600202	哈空调	125,900	739,033.00	1.44

10	300845	捷安高科	65,400	737,058.00	1.43
11	688659	元琛科技	76,700	724,815.00	1.41
12	002360	同德化工	144,400	698,896.00	1.36
13	605069	正和生态	45,900	674,730.00	1.31
14	002817	黄山胶囊	87,900	668,040.00	1.30
15	300929	华骐环保	61,700	663,275.00	1.29
16	002114	罗平锌电	67,000	564,140.00	1.10
17	000803	山高环能	73,300	524,095.00	1.02
18	600232	金鹰股份	62,300	492,793.00	0.96
19	002809	红墙股份	45,100	482,119.00	0.94
20	002723	小崧股份	55,600	470,932.00	0.92
21	300422	博世科	100,400	460,836.00	0.90
22	300437	清水源	28,500	455,145.00	0.88
23	300387	富邦科技	50,500	429,755.00	0.84
24	000952	广济药业	60,900	428,127.00	0.83
25	603797	联泰环保	90,000	420,300.00	0.82
26	002909	集泰股份	61,700	420,177.00	0.82
27	603331	百达精工	28,100	400,425.00	0.78
28	300190	维尔利	92,100	395,109.00	0.77
29	002748	世龙实业	30,600	395,046.00	0.77
30	688021	奥福科技	21,500	394,525.00	0.77
31	688681	科汇股份	21,500	377,970.00	0.73
32	300305	裕兴股份	62,000	368,900.00	0.72
33	601798	蓝科高新	41,000	363,670.00	0.71
34	002381	双箭股份	54,900	361,791.00	0.70
35	603028	赛福天	38,800	361,616.00	0.70
36	300594	朗进科技	18,400	360,824.00	0.70
37	301037	保立佳	24,800	357,120.00	0.69
38	000545	金浦钛业	126,200	355,884.00	0.69
39	688528	秦川物联	32,100	345,717.00	0.67
40	603700	宁水集团	25,300	343,827.00	0.67
41	002873	新天药业	33,900	336,288.00	0.65
42	603968	醋化股份	28,800	321,696.00	0.63
43	688038	中科通达	18,000	318,060.00	0.62
44	300417	南华仪器	22,400	313,376.00	0.61
45	605001	威奥股份	40,900	312,067.00	0.61
46	600768	宁波富邦	22,200	310,800.00	0.60
47	002551	尚荣医疗	83,300	304,045.00	0.59
48	300405	科隆股份	46,500	296,670.00	0.58
49	002998	优彩资源	38,700	292,185.00	0.57
50	000159	国际实业	50,500	291,890.00	0.57
51	603617	君禾股份	38,100	287,274.00	0.56
52	000790	华神科技	72,300	279,801.00	0.54

53	300823	建科智能	17,600	274,912.00	0.53
54	300103	达刚控股	34,100	273,823.00	0.53
55	603729	龙韵股份	17,000	273,530.00	0.53
56	688616	西力科技	22,300	272,729.00	0.53
57	603356	华菱精工	18,800	266,772.00	0.52
58	603041	美思德	22,000	265,100.00	0.52
59	300614	百川畅银	20,500	259,940.00	0.51
60	300335	迪森股份	44,700	257,472.00	0.50
61	688296	和达科技	19,200	254,400.00	0.49
62	300074	华平股份	53,300	245,713.00	0.48
63	300854	中兰环保	14,500	244,180.00	0.47
64	300958	建工修复	19,300	239,513.00	0.47
65	002566	益盛药业	30,700	234,241.00	0.46
66	002442	龙星科技	37,700	234,117.00	0.45
67	300575	中旗股份	39,000	227,370.00	0.44
68	300371	汇中股份	17,800	223,746.00	0.43
69	600847	万里股份	18,900	219,618.00	0.43
70	300838	浙江力诺	14,400	219,600.00	0.43
71	300610	晨化股份	18,800	218,268.00	0.42
72	300912	凯龙高科	12,700	209,550.00	0.41
73	000826	启迪环境	93,200	206,904.00	0.40
74	603578	三星新材	16,500	199,320.00	0.39
75	300535	达威股份	11,000	196,460.00	0.38
76	688517	金冠电气	12,600	196,434.00	0.38
77	688597	煜邦电力	23,900	196,219.00	0.38
78	301519	舜禹股份	14,100	189,222.00	0.37
79	603073	彩蝶实业	10,000	187,900.00	0.37
80	688329	艾隆科技	8,800	187,352.00	0.36
81	688671	碧兴物联	7,200	178,344.00	0.35
82	000757	浩物股份	36,600	178,242.00	0.35
83	002921	联诚精密	10,400	177,008.00	0.34
84	002391	长青股份	29,700	176,121.00	0.34
85	688309	恒誉环保	7,000	168,910.00	0.33
86	600594	益佰制药	42,400	168,752.00	0.33
87	300163	先锋新材	41,500	168,075.00	0.33
88	300176	鸿特科技	25,000	166,750.00	0.32
89	688189	南新制药	20,900	166,573.00	0.32
90	603321	梅轮电梯	20,600	165,624.00	0.32
91	601616	广电电气	42,700	164,822.00	0.32
92	600099	林海股份	15,700	164,065.00	0.32
93	300665	飞鹿股份	16,200	158,112.00	0.31
94	688272	富吉瑞	4,700	153,502.00	0.30
95	688485	九州一轨	8,300	148,072.00	0.29

96	688217	睿昂基因	5,600	147,560.00	0.29
97	002105	信隆健康	18,200	133,224.00	0.26
98	301081	严牌股份	12,800	129,664.00	0.25
99	920857	泓禧科技	3,600	127,404.00	0.25
100	603122	合富中国	5,100	124,440.00	0.24
101	000890	法尔胜	24,500	124,215.00	0.24
102	000802	北京文化	27,200	123,760.00	0.24
103	300334	津膜科技	17,700	123,192.00	0.24
104	001231	农心科技	4,800	119,712.00	0.23
105	301105	鸿铭股份	2,500	119,175.00	0.23
106	300935	盈建科	3,800	115,292.00	0.22
107	920274	宏裕包材	4,000	115,040.00	0.22
108	603029	天鹅股份	6,100	111,264.00	0.22
109	001259	利仁科技	3,700	111,037.00	0.22
110	300385	雪浪环境	17,800	110,716.00	0.22
111	300076	GQY 视讯	13,300	110,390.00	0.21
112	688026	洁特生物	6,800	109,548.00	0.21
113	001260	坤泰股份	5,400	108,648.00	0.21
114	001373	翔腾新材	3,300	106,524.00	0.21
115	688092	爱科科技	4,200	105,588.00	0.21
116	001336	楚环科技	4,300	105,178.00	0.20
117	300923	研奥股份	4,100	104,673.00	0.20
118	688004	博汇科技	4,500	104,085.00	0.20
119	002802	洪汇新材	8,300	103,252.00	0.20
120	603880	南卫股份	16,400	102,172.00	0.20
121	600455	博通股份	3,900	101,283.00	0.20
122	000692	惠天热电	29,400	101,136.00	0.20
123	301049	超越科技	4,700	100,956.00	0.20
124	688178	万德斯	4,200	100,926.00	0.20
125	688420	美腾科技	4,200	100,254.00	0.19
126	300710	万隆光电	3,200	99,680.00	0.19
127	603278	大业股份	5,800	98,832.00	0.19
128	301273	瑞晨环保	3,700	98,013.00	0.19
129	600149	廊坊发展	19,600	97,804.00	0.19
130	688395	正弦电气	4,000	97,280.00	0.19
131	688193	仁度生物	2,000	96,740.00	0.19
132	301163	宏德股份	3,600	96,444.00	0.19
133	301372	科净源	3,800	96,368.00	0.19
134	301515	港通医疗	4,800	96,288.00	0.19
135	002471	中超控股	12,000	96,240.00	0.19
136	603188	亚邦股份	20,800	95,472.00	0.19
137	605177	东亚药业	5,300	94,340.00	0.18
138	688450	光格科技	3,400	93,772.00	0.18

139	688067	爱威科技	3,800	93,328.00	0.18
140	688353	华盛锂电	800	90,960.00	0.18
141	688701	卓锦股份	11,000	89,650.00	0.17
142	600969	郴电国际	8,700	89,001.00	0.17
143	002753	永东股份	12,400	88,412.00	0.17
144	688638	誉辰智能	2,400	87,192.00	0.17
145	300717	华信新材	4,500	85,680.00	0.17
146	300030	阳普医疗	11,600	85,376.00	0.17
147	603879	永悦科技	12,000	84,960.00	0.17
148	002712	思美传媒	15,200	84,512.00	0.16
149	300412	迦南科技	15,700	83,995.00	0.16
150	300692	中赋科技	9,800	82,320.00	0.16
151	920580	科创新材	5,500	81,620.00	0.16
152	300992	泰福泵业	3,000	81,000.00	0.16
153	920370	新安洁	19,067	78,937.38	0.15
154	920765	美之高	3,800	78,850.00	0.15
155	002700	万慷能源	11,700	78,507.00	0.15
156	002638	勤上股份	25,200	77,868.00	0.15
157	920679	前进科技	3,900	77,805.00	0.15
158	603086	先达股份	9,400	77,268.00	0.15
159	301131	聚赛龙	1,600	77,232.00	0.15
160	688466	金科环境	4,700	76,469.00	0.15
161	300155	安居宝	11,600	76,212.00	0.15
162	300112	万讯自控	8,800	75,768.00	0.15
163	920974	凯大催化	9,600	75,744.00	0.15
164	920030	德众汽车	11,000	75,350.00	0.15
165	920608	丰安股份	4,000	74,840.00	0.15
166	920422	润普食品	5,800	74,820.00	0.15
167	920873	中设咨询	9,500	73,530.00	0.14
168	920641	格利尔	4,000	73,360.00	0.14
169	920146	华阳变速	8,500	73,355.00	0.14
170	600671	天目药业	4,200	72,702.00	0.14
171	920527	夜光明	4,000	72,440.00	0.14
172	920768	拾比佰	6,000	72,300.00	0.14
173	688355	明志科技	4,000	71,200.00	0.14
174	920719	宁新新材	5,500	70,950.00	0.14
175	920832	齐鲁华信	9,700	70,422.00	0.14
176	920504	博迅生物	2,900	70,267.00	0.14
177	300169	天晟新材	11,200	70,000.00	0.14
178	920471	美邦科技	5,500	69,795.00	0.14
179	920118	太湖远大	3,100	69,781.00	0.14
180	688045	必易微	1,800	69,642.00	0.14
181	920057	百甲科技	10,700	69,336.00	0.13

182	301130	西点药业	2,400	68,496.00	0.13
183	600241	时代万恒	8,200	68,470.00	0.13
184	920267	鑫汇科	3,000	68,100.00	0.13
185	920553	凯腾精工	6,800	67,524.00	0.13
186	920260	中寰股份	6,100	66,978.00	0.13
187	300141	和顺电气	5,300	66,621.00	0.13
188	300644	南京聚隆	1,800	66,438.00	0.13
189	920519	万德股份	5,500	66,165.00	0.13
190	688078	龙软科技	2,400	66,000.00	0.13
191	300126	锐奇股份	7,700	65,912.00	0.13
192	300069	金利华电	3,800	65,550.00	0.13
193	603139	康惠股份	3,200	65,504.00	0.13
194	603819	神力股份	5,200	63,128.00	0.12
195	920970	大禹生物	8,200	63,058.00	0.12
196	688069	德林海	2,800	62,804.00	0.12
197	000510	新金路	5,400	62,532.00	0.12
198	301125	腾亚精工	3,400	62,492.00	0.12
199	920149	旭杰科技	5,400	62,478.00	0.12
200	002857	三晖电气	3,000	62,220.00	0.12
201	300626	华瑞股份	3,900	62,049.00	0.12
202	300736	百邦科技	4,000	62,040.00	0.12
203	001218	丽臣实业	2,700	61,506.00	0.12
204	920414	欧普泰	5,400	60,750.00	0.12
205	000593	德龙汇能	5,300	59,360.00	0.12
206	001230	劲旅环境	2,700	58,833.00	0.11
207	688310	迈得医疗	3,800	58,254.00	0.11
208	002795	永和智控	9,200	57,960.00	0.11
209	920717	瑞星股份	5,200	57,720.00	0.11
210	920110	雷特科技	1,600	57,200.00	0.11
211	688619	罗普特	4,200	57,120.00	0.11
212	688393	安必平	2,400	56,856.00	0.11
213	301107	瑜欣电子	2,000	56,480.00	0.11
214	688655	迅捷兴	3,200	54,816.00	0.11
215	688573	信宇人	2,400	54,696.00	0.11
216	688670	金迪克	2,700	54,621.00	0.11
217	688056	莱伯泰科	1,600	53,776.00	0.10
218	688121	卓然股份	4,800	52,416.00	0.10
219	300389	艾比森	3,100	50,313.00	0.10
220	300948	冠中生态	2,300	49,887.00	0.10
221	688058	宝兰德	1,800	49,014.00	0.10
222	603161	科华控股	3,500	48,055.00	0.09
223	688679	通源环境	1,800	47,880.00	0.09
224	688367	工大高科	1,500	46,440.00	0.09

225	301167	建研设计	2,800	45,500.00	0.09
226	300062	中能电气	5,400	44,982.00	0.09
227	688156	路德科技	2,800	44,828.00	0.09
228	688335	复洁科技	1,600	43,136.00	0.08
229	002578	闽发铝业	9,200	41,308.00	0.08
230	002842	翔鹭钨业	2,600	37,596.00	0.07
231	000546	金圆股份	5,800	37,004.00	0.07
232	600302	标准股份	3,500	36,715.00	0.07
233	300552	万集科技	1,200	36,432.00	0.07
234	002136	安纳达	3,000	36,420.00	0.07
235	301002	崧盛股份	1,000	36,410.00	0.07
236	688350	富淼科技	1,400	36,022.00	0.07
237	603937	丽岛新材	3,000	35,970.00	0.07
238	603172	万丰股份	2,000	35,600.00	0.07
239	300427	红相股份	2,900	35,525.00	0.07
240	002196	方正电机	2,200	34,914.00	0.07
241	688636	智明达	800	34,272.00	0.07
242	603311	金海高科	2,200	33,616.00	0.07
243	301006	迈拓股份	2,000	32,980.00	0.06
244	002863	今飞凯达	5,400	31,698.00	0.06
245	000600	建投能源	3,600	30,708.00	0.06
246	600469	风神股份	4,400	30,536.00	0.06
247	002363	隆基机械	3,000	30,300.00	0.06
248	002877	智能自控	3,300	30,294.00	0.06
249	002636	金安国纪	1,800	30,078.00	0.06
250	600288	大恒科技	2,000	29,960.00	0.06
251	603186	华正新材	600	29,760.00	0.06
252	688557	兰剑智能	800	29,144.00	0.06
253	002355	兴民智通	4,800	29,088.00	0.06
254	300478	杭州高新	900	29,070.00	0.06
255	300995	奇德新材	700	28,917.00	0.06
256	603080	新疆火炬	1,200	28,344.00	0.06
257	300509	新美星	2,200	28,248.00	0.05
258	688667	菱电电控	400	28,168.00	0.05
259	688138	清溢光电	1,000	28,160.00	0.05
260	688419	耐科装备	1,000	27,990.00	0.05
261	600386	北巴传媒	6,300	27,657.00	0.05
262	603045	福达合金	1,400	27,510.00	0.05
263	688015	交控科技	1,200	27,336.00	0.05
264	001278	一彬科技	1,400	27,076.00	0.05
265	002942	新农股份	1,400	26,908.00	0.05
266	605259	绿田机械	1,200	26,856.00	0.05
267	688216	气派科技	1,200	26,736.00	0.05

268	603586	金麒麟	1,400	26,712.00	0.05
269	603320	迪贝电气	1,400	26,684.00	0.05
270	300562	乐心医疗	2,000	26,660.00	0.05
271	300150	世纪瑞尔	5,000	26,450.00	0.05
272	688148	芳源股份	3,000	26,310.00	0.05
273	688595	芯海科技	800	26,240.00	0.05
274	301043	绿岛风	400	26,120.00	0.05
275	000407	胜利股份	5,200	26,104.00	0.05
276	600262	北方股份	1,000	26,030.00	0.05
277	002826	易明医药	1,400	25,732.00	0.05
278	600080	金花股份	3,400	25,636.00	0.05
279	301300	远翔新材	600	25,440.00	0.05
280	300596	利安隆	600	25,326.00	0.05
281	300187	永清环保	5,200	25,324.00	0.05
282	301298	东利机械	1,600	25,312.00	0.05
283	300597	吉大通信	2,700	24,948.00	0.05
284	300407	凯发电气	2,200	24,904.00	0.05
285	002396	星网锐捷	800	24,240.00	0.05
286	688316	青云科技	400	24,068.00	0.05
287	003017	大洋生物	800	23,888.00	0.05
288	600470	六国化工	3,800	22,724.00	0.04
289	300317	珈伟新能	5,900	22,656.00	0.04
290	688129	东来技术	1,100	22,253.00	0.04
291	002760	凤形股份	1,000	21,710.00	0.04
292	300721	怡达股份	1,700	21,641.00	0.04
293	688307	中润光学	500	21,605.00	0.04
294	000931	中关村	4,400	21,428.00	0.04
295	002788	鹭燕医药	1,000	21,180.00	0.04
296	301233	盛帮股份	400	21,168.00	0.04
297	301077	星华新材	800	20,704.00	0.04
298	688251	井松智能	700	20,580.00	0.04
299	688365	光云科技	1,200	20,244.00	0.04
300	002666	德联集团	3,600	19,836.00	0.04
301	603391	力聚热能	300	19,641.00	0.04
302	603192	汇得科技	700	18,368.00	0.04
303	920023	田野股份	3,800	17,936.00	0.03
304	603335	迪生力	3,100	17,453.00	0.03
305	600732	爱旭股份	1,300	17,420.00	0.03
306	002825	纳尔股份	1,500	17,235.00	0.03
307	301126	达嘉维康	1,400	17,206.00	0.03
308	300269	联建光电	2,600	17,056.00	0.03
309	603577	汇金通	1,600	16,832.00	0.03
310	301309	万得凯	600	16,812.00	0.03

311	301059	金三江	1,300	16,380.00	0.03
312	920685	新芝生物	1,200	16,368.00	0.03
313	920046	亿能电力	1,200	16,140.00	0.03
314	920090	同辉信息	2,500	15,875.00	0.03
315	002768	国恩股份	300	15,804.00	0.03
316	920810	春光智能	1,200	15,768.00	0.03
317	301158	德石股份	700	15,659.00	0.03
318	002480	新筑股份	2,500	15,550.00	0.03
319	301231	荣信文化	500	15,540.00	0.03
320	920802	保丽洁	1,000	15,410.00	0.03
321	300659	中孚信息	1,000	15,360.00	0.03
322	600869	远东股份	1,900	15,295.00	0.03
323	603788	宁波高发	900	14,706.00	0.03
324	301197	工大科雅	700	14,588.00	0.03
325	688030	山石网科	800	14,536.00	0.03
326	920266	生物谷	1,600	14,512.00	0.03
327	000680	山推股份	1,200	14,364.00	0.03
328	920895	花溪科技	700	14,322.00	0.03
329	301022	海泰科	400	13,236.00	0.03
330	688203	海正生材	1,000	12,780.00	0.02
331	603332	苏州龙杰	900	12,492.00	0.02
332	600686	金龙汽车	700	12,418.00	0.02
333	002824	和胜股份	600	11,640.00	0.02
334	002350	北京科锐	1,400	11,396.00	0.02
335	300988	津荣天宇	500	11,375.00	0.02
336	301040	中环海陆	400	11,356.00	0.02
337	603817	海峡环保	1,600	11,344.00	0.02
338	002583	海能达	1,000	11,320.00	0.02
339	002337	赛象科技	1,700	11,169.00	0.02
340	300214	日科化学	1,600	10,688.00	0.02
341	603759	海天股份	1,000	10,540.00	0.02
342	688509	正元地信	1,900	10,431.00	0.02
343	300423	昇辉科技	1,200	10,056.00	0.02
344	603999	读者传媒	1,400	9,842.00	0.02
345	300813	泰林生物	400	9,828.00	0.02
346	688285	高铁电气	1,100	9,548.00	0.02
347	600052	东望时代	2,000	9,420.00	0.02
348	002887	绿茵生态	1,000	9,360.00	0.02
349	300428	立中集团	400	9,340.00	0.02
350	000731	四川美丰	1,400	9,156.00	0.02
351	601999	出版传媒	1,300	8,931.00	0.02
352	300081	恒信东方	1,700	8,823.00	0.02
353	300239	东宝生物	1,500	8,790.00	0.02

354	300619	金银河	200	8,780.00	0.02
355	603318	水发燃气	1,300	8,710.00	0.02
356	603330	天洋新材	1,200	8,688.00	0.02
357	605366	宏柏新材	1,400	8,680.00	0.02
358	002957	科瑞技术	400	8,660.00	0.02
359	603980	吉华集团	1,700	8,568.00	0.02
360	600613	神奇制药	1,400	8,498.00	0.02
361	603012	创力集团	1,400	8,456.00	0.02
362	300425	中建环能	1,700	8,415.00	0.02
363	002412	汉森制药	1,300	8,333.00	0.02
364	600774	汉商集团	900	8,226.00	0.02
365	600531	豫光金铅	700	8,225.00	0.02
366	002282	博深股份	1,100	8,085.00	0.02
367	300639	凯普生物	1,500	8,070.00	0.02
368	300465	高伟达	400	8,052.00	0.02
369	003042	中农联合	500	8,030.00	0.02
370	300145	南方泵业	1,700	8,024.00	0.02
371	000788	北大医药	1,300	7,943.00	0.02
372	000707	双环科技	1,300	7,865.00	0.02
373	600215	派斯林	1,100	7,865.00	0.02
374	300510	金冠股份	1,900	7,847.00	0.02
375	000605	渤海股份	1,100	7,381.00	0.01
376	301503	智迪科技	200	7,212.00	0.01
377	300381	溢多利	1,100	7,172.00	0.01
378	002022	科华生物	1,200	7,128.00	0.01
379	002334	英威腾	700	6,314.00	0.01
380	688162	巨一科技	200	6,160.00	0.01
381	600333	长春燃气	1,100	6,083.00	0.01
382	300513	恒实科技	640	6,073.60	0.01
383	002912	中新赛克	200	6,028.00	0.01
384	300971	博亚精工	200	4,892.00	0.01
385	300250	初灵信息	200	4,806.00	0.01
386	002009	天奇股份	200	4,524.00	0.01
387	603803	瑞斯康达	400	4,436.00	0.01
388	600067	冠城新材	800	3,320.00	0.01
389	600579	中化装备	400	3,320.00	0.01
390	688207	格灵深瞳	200	3,040.00	0.01
391	603876	鼎胜新材	200	3,002.00	0.01
392	300546	雄帝科技	100	2,619.00	0.01
393	002691	冀凯股份	200	1,810.00	0.00
394	603928	兴业股份	100	1,605.00	0.00
395	300787	海能实业	100	1,175.00	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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688659	元琛科技	3,860,422.18	11.39
2	600241	时代万恒	3,855,087.00	11.37
3	688096	京源环保	3,488,297.78	10.29
4	002360	同德化工	3,424,561.00	10.10
5	600202	哈空调	3,366,992.00	9.93
6	600303	曙光股份	3,342,753.00	9.86
7	600232	金鹰股份	3,249,741.00	9.58
8	002591	恒大高新	3,195,032.00	9.42
9	300126	锐奇股份	3,163,270.00	9.33
10	000952	广济药业	3,120,793.00	9.20
11	603023	威帝股份	3,109,179.00	9.17
12	300305	裕兴股份	3,081,956.00	9.09
13	002999	天禾股份	2,828,722.00	8.34
14	300437	清水源	2,796,074.00	8.25
15	300074	华平股份	2,706,322.00	7.98
16	603488	展鹏科技	2,697,408.00	7.96
17	002748	世龙实业	2,658,781.00	7.84
18	002998	优彩资源	2,585,195.00	7.62
19	300246	宝莱特	2,543,652.00	7.50
20	300462	ST 华铭	2,514,032.00	7.42
21	688565	力源科技	2,370,702.02	6.99
22	002909	集泰股份	2,190,415.00	6.46
23	688528	秦川物联	2,149,221.98	6.34
24	000790	华神科技	2,129,786.00	6.28
25	603903	中持股份	2,100,518.00	6.20
26	300412	迦南科技	2,050,116.00	6.05
27	002817	黄山胶囊	1,975,580.00	5.83
28	002873	新天药业	1,953,320.00	5.76
29	300929	华骐环保	1,953,157.00	5.76
30	000545	金浦钛业	1,917,058.00	5.65
31	000757	浩物股份	1,767,563.00	5.21
32	300422	博世科	1,731,242.00	5.11
33	603331	百达精工	1,617,460.00	4.77
34	300283	温州宏丰	1,615,521.36	4.76
35	688687	凯因科技	1,547,522.69	4.56
36	002753	永东股份	1,543,924.00	4.55
37	002381	双箭股份	1,542,137.00	4.55
38	688619	罗普特	1,529,379.57	4.51

39	300086	康芝药业	1,522,682.00	4.49
40	000826	启迪环境	1,506,478.00	4.44
41	603321	梅轮电梯	1,463,834.00	4.32
42	688189	南新制药	1,460,633.91	4.31
43	000593	德龙汇能	1,429,666.00	4.22
44	300163	先锋新材	1,413,374.00	4.17
45	688021	奥福科技	1,367,563.33	4.03
46	300845	捷安高科	1,349,938.00	3.98
47	002114	罗平锌电	1,347,938.00	3.98
48	300686	智动力	1,346,021.00	3.97
49	300190	维尔利	1,260,362.00	3.72
50	601616	广电电气	1,207,825.00	3.56
51	300195	长荣股份	1,185,499.00	3.50
52	300670	大烨智能	1,177,703.00	3.47
53	600847	万里股份	1,173,451.00	3.46
54	688129	东来技术	1,170,798.95	3.45
55	002442	龙星科技	1,154,842.00	3.41
56	300335	迪森股份	1,148,810.00	3.39
57	300610	晨化股份	1,143,185.00	3.37
58	603797	联泰环保	1,135,480.00	3.35
59	300387	富邦科技	1,118,593.00	3.30
60	688117	圣诺生物	1,107,744.39	3.27
61	000803	山高环能	1,094,856.00	3.23
62	603332	苏州龙杰	1,092,970.00	3.22
63	300112	万讯自控	1,061,725.00	3.13
64	605069	正和生态	1,044,346.00	3.08
65	300385	雪浪环境	1,033,284.00	3.05
66	600731	湖南海利	1,011,756.00	2.98
67	002136	安纳达	961,668.00	2.84
68	002809	红墙股份	936,342.02	2.76
69	688597	煜邦电力	930,312.73	2.74
70	300931	通用电梯	925,074.00	2.73
71	002723	小崧股份	915,548.00	2.70
72	002700	万憬能源	901,970.00	2.66
73	603188	亚邦股份	899,419.00	2.65
74	300018	中元股份	896,267.00	2.64
75	000159	国际实业	887,837.00	2.62
76	603577	汇金通	876,155.00	2.58
77	301209	联合化学	863,720.00	2.55
78	002546	新联电子	859,103.00	2.53
79	000407	胜利股份	857,397.00	2.53
80	002566	益盛药业	855,019.00	2.52
81	300912	凯龙高科	847,820.00	2.50

82	002105	信隆健康	819,457.00	2.42
83	688485	九州一轨	808,025.06	2.38
84	002578	闽发铝业	783,820.00	2.31
85	002712	思美传媒	782,063.00	2.31
86	300594	朗进科技	780,805.00	2.30
87	301107	瑜欣电子	779,192.00	2.30
88	002370	亚太药业	772,900.00	2.28
89	603617	君禾股份	770,282.00	2.27
90	300854	中兰环保	768,540.00	2.27
91	003018	金富科技	767,884.00	2.26
92	300198	ST 纳川	763,232.00	2.25
93	300513	恒实科技	760,208.20	2.24
94	688679	通源环境	747,837.61	2.21
95	002471	中超控股	741,735.00	2.19
96	688296	和达科技	736,052.37	2.17
97	300030	阳普医疗	726,795.00	2.14
98	688509	正元地信	720,136.46	2.12
99	603028	赛福天	714,543.00	2.11
100	688616	西力科技	709,967.63	2.09
101	001230	劲旅环境	707,048.00	2.09
102	002551	尚荣医疗	700,492.00	2.07
103	300155	安居宝	696,647.00	2.05
104	300692	中赋科技	686,920.00	2.03

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600241	时代万恒	3,893,504.00	11.48
2	603903	中持股份	3,427,469.00	10.11
3	300126	锐奇股份	3,382,604.00	9.98
4	688659	元琛科技	3,321,094.02	9.80
5	600232	金鹰股份	2,968,176.00	8.75
6	300437	清水源	2,949,533.00	8.70
7	000952	广济药业	2,781,863.80	8.20
8	300074	华平股份	2,763,161.00	8.15
9	603023	威帝股份	2,736,832.00	8.07
10	300305	裕兴股份	2,733,946.00	8.06
11	600202	哈空调	2,627,752.00	7.75
12	688189	南新制药	2,614,365.34	7.71
13	688096	京源环保	2,600,060.58	7.67

14	002591	恒大高新	2,592,981.00	7.65
15	002360	同德化工	2,584,866.00	7.62
16	300462	ST 华铭	2,504,017.00	7.39
17	002748	世龙实业	2,500,247.00	7.37
18	600303	曙光股份	2,498,770.00	7.37
19	300412	迦南科技	2,467,941.00	7.28
20	301209	联合化学	2,425,495.40	7.15
21	300086	康芝药业	2,328,572.00	6.87
22	002998	优彩资源	2,299,766.00	6.78
23	300246	宝莱特	2,154,958.00	6.36
24	002999	天禾股份	1,953,602.00	5.76
25	688215	瑞晟智能	1,930,269.05	5.69
26	002909	集泰股份	1,916,373.00	5.65
27	300283	温州宏丰	1,897,614.86	5.60
28	688565	力源科技	1,894,622.12	5.59
29	000757	浩物股份	1,859,943.00	5.49
30	000790	华神科技	1,858,258.00	5.48
31	000593	德龙汇能	1,840,801.00	5.43
32	688619	罗普特	1,805,965.11	5.33
33	002873	新天药业	1,777,795.00	5.24
34	688528	秦川物联	1,747,014.37	5.15
35	603332	苏州龙杰	1,720,476.00	5.07
36	300195	长荣股份	1,694,832.00	5.00
37	603488	展鹏科技	1,676,917.00	4.95
38	688687	凯因科技	1,612,119.22	4.75
39	002370	亚太药业	1,593,129.00	4.70
40	300686	智动力	1,580,523.00	4.66
41	300112	万讯自控	1,541,465.00	4.55
42	000545	金浦钛业	1,530,493.00	4.51
43	300335	迪森股份	1,475,833.00	4.35
44	002753	永东股份	1,451,574.00	4.28
45	688117	圣诺生物	1,439,071.28	4.24
46	000826	启迪环境	1,418,288.00	4.18
47	300163	先锋新材	1,378,621.00	4.07
48	603321	梅轮电梯	1,375,041.00	4.06
49	300670	大烨智能	1,340,004.00	3.95
50	688129	东来技术	1,314,052.89	3.88
51	603331	百达精工	1,291,716.00	3.81
52	002817	黄山胶囊	1,275,083.00	3.76
53	688328	深科达	1,269,973.87	3.75
54	688597	煜邦电力	1,254,833.20	3.70
55	300931	通用电梯	1,234,380.00	3.64
56	300929	华骐环保	1,195,146.00	3.53

57	300422	博世科	1,192,910.00	3.52
58	603637	镇海股份	1,182,453.00	3.49
59	002381	双箭股份	1,161,257.00	3.43
60	002471	中超控股	1,120,869.00	3.31
61	301022	海泰科	1,113,330.00	3.28
62	600731	湖南海利	1,105,285.00	3.26
63	688485	九州一轨	1,101,043.92	3.25
64	002566	益盛药业	1,101,017.00	3.25
65	688616	西力科技	1,050,645.11	3.10
66	601616	广电电气	1,034,957.00	3.05
67	002546	新联电子	999,450.00	2.95
68	300610	晨化股份	998,470.00	2.94
69	002209	达意隆	985,534.00	2.91
70	688021	奥福科技	980,968.60	2.89
71	300018	中元股份	966,512.00	2.85
72	300385	雪浪环境	965,736.00	2.85
73	002136	安纳达	957,133.00	2.82
74	301107	瑜欣电子	940,681.20	2.77
75	603577	汇金通	936,660.00	2.76
76	603122	合富中国	934,759.00	2.76
77	688296	和达科技	933,053.84	2.75
78	300150	世纪瑞尔	929,462.00	2.74
79	600847	万里股份	913,982.00	2.70
80	002442	龙星科技	912,972.00	2.69
81	000407	胜利股份	893,150.00	2.63
82	688369	致远互联	879,428.37	2.59
83	300190	维尔利	876,900.00	2.59
84	003018	金富科技	876,629.00	2.59
85	002887	绿茵生态	858,708.00	2.53
86	002114	罗平锌电	847,313.00	2.50
87	603188	亚邦股份	845,944.00	2.50
88	600080	金花股份	829,159.00	2.45
89	002578	闽发铝业	825,254.00	2.43
90	300198	ST纳川	817,860.00	2.41
91	688670	金迪克	813,067.10	2.40
92	300508	维宏股份	786,214.00	2.32
93	688345	博力威	783,556.14	2.31
94	002700	万懋能源	764,437.00	2.25
95	002826	易明医药	754,204.00	2.22
96	688509	正元地信	751,334.87	2.22
97	603039	泛微网络	749,319.00	2.21
98	001230	劲旅环境	744,211.00	2.20
99	002825	纳尔股份	739,971.40	2.18

100	688679	通源环境	736,215.58	2.17
101	688316	青云科技	728,854.24	2.15
102	688208	道通科技	723,813.60	2.13
103	688030	山石网科	721,636.95	2.13
104	301192	泰祥股份	718,167.00	2.12
105	603506	南都物业	715,631.00	2.11
106	603192	汇得科技	703,989.00	2.08
107	300513	恒实科技	699,512.00	2.06
108	300391	*ST 长药	689,545.00	2.03
109	300030	阳普医疗	689,272.00	2.03
110	603797	联泰环保	682,742.00	2.01
111	002671	龙泉股份	681,692.00	2.01
112	002105	信隆健康	679,429.00	2.00

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	262,662,748.20
卖出股票收入（成交）总额	265,504,209.77

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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 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受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本报告期内未发现本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内不存在所投资的前十名股票超出基金合同规定之备选股票库的情况。

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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	99,363.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,363.52

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

份额级别	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
渤海汇金新动能主题混合 A	1,334	20,617.73	7,245,137.86	26.34%	20,258,912.40	73.66%
渤海汇金新动能主题混合 C	1,243	10,339.48	-	-	12,851,976.24	100.00%
合计	2,512	16,065.30	7,245,137.86	17.95%	33,110,888.64	82.05%

注：期末有 65 名基金份额持有人同时持有渤海汇金新动能主题混合 A 份额和渤海汇金新动能主题混合 C 份额。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	渤海汇金新动能主题混合 A	2,734,472.97	9.94%
	渤海汇金新动能主题混合 C	5,267.36	0.04%
	合计	2,739,740.33	6.79%

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情况

项目	份额级别	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	渤海汇金新动能主题混合 A	>100
	渤海汇金新动能主题混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	渤海汇金新动能主题混合 A	>100
	渤海汇金新动能	0

	主题混合 C	
	合计	>100

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：无

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	渤海汇金新动能主题混合 A	渤海汇金新动能主题混合 C
基金合同生效日（2021 年 03 月 23 日）基金份额总额	217,088,436.50	-
本报告期期初基金份额总额	37,008,472.60	3,473,032.80
本报告期基金总申购份额	38,745,140.39	69,121,607.65
减：本报告期基金总赎回份额	48,249,562.73	59,742,664.21
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	27,504,050.26	12,851,976.24

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 2025 年 9 月 6 日发布公告，经管理人股东渤海证券股份有限公司研究决定，免去刘嫣女士公司董事职务，其不再担任公司副董事长职务。

2、本基金管理人于 2025 年 10 月 1 日发布公告，自 2025 年 9 月 30 日起，刘嫣女士担任渤海汇金证券资产管理有限公司总审计师，公司首席信息官李江先生离任。

3、本基金管理人于 2025 年 10 月 18 日发布公告，管理人股东单位任命齐朝晖、吴国威、麻众志、张建雷、黄立立、高天毅、何青、王延敏、王蓉为公司第四届董事会董事；其中何青、王延敏、王蓉为渤海汇金公司第四届董事会独立董事。

4、本基金管理人于 2025 年 11 月 28 日发布公告，自 2025 年 11 月 26 日起，陆维先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司首席信息官。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼，无涉及基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为其审计机构。本报告期应支付德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 0.00 元。截至本报告期末，该审计机构已为本基金提供审计服务 4 年 3 个月。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚的情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚的情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	524,603,609.04	99.33%	204,668.95	99.33%	-
中泰证券	3	3,563,348.93	0.67%	1,389.77	0.67%	新增 1 个

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，与其签订租用交易单元协议/证券经纪服务协议。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：本基金本报告期内新增的证券公司交易单元为中泰证券交易单元。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）》的报告期为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日，报告的主要内容为报告期间本公司旗下存续过的所有公募基金通过租用境内证券公司交易单元和委托境内证券公司进行证券投资及佣金支付情况，包括报告期间成立、清算、转型（如有）的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

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 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-22
2	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-01-22
3	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加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	中国证监会规定媒介	2025-02-27
4	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金在直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2025-03-17
5	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-28
6	渤海汇金新动能主题混合型证	中国证监会规定媒介	2025-03-31

	券投资基金 2024 年年度报告		
7	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-03-31
8	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
9	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
10	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加麦高证券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	中国证监会规定媒介	2025-05-19
11	渤海汇金证券资产管理有限公司关于民商基金销售（上海）有限公司终止代销旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-12
12	渤海汇金证券资产管理有限公司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	中国证监会规定媒介	2025-06-27
13	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰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	中国证监会规定媒介	2025-07-02
14	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广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	中国证监会规定媒介	2025-07-03
15	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-07-21
16	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-07-21
17	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动	中国证监会规定媒介	2025-07-24

	的公告		
18	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票及相关风险提示的公告	中国证监会规定媒介	2025-08-08
19	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加国泰海通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	中国证监会规定媒介	2025-08-08
20	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会规定媒介	2025-08-30
21	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-08-30
22	渤海汇金证券资产管理有限公司关于董事会成员调整的公告	中国证监会规定媒介	2025-09-06
23	渤海汇金证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025-10-01
24	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）（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-10-10
25	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-10-10
26	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-10-10
27	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	中国证监会规定媒介	2025-10-10
28	渤海汇金证券资产管理有限公司关于浦领基金销售有限公司终止代销旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-16
29	渤海汇金证券资产管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-18
30	渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-10-28
31	渤海汇金证券资产管理有限公司	中国证监会规定媒介	2025-10-28

	司旗下基金 2025 年第 3 季度报告的提示性公告		
32	渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025-11-28
33	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加渤海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	中国证监会规定媒介	2025-12-03
34	渤海汇金证券资产管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-05
35	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司作为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-11

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250103-20251113	1,001,291.67	14,205,644.02	8,042,941.00	7,163,994.69	17.75%
产品特有风险							
<p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。 2. 单一大额投资者大额赎回时为应对赎回证券变现产生的冲击成本的风险。 3. 单一大额投资者退出后，可能出现迷你基金的情形，可能影响投资目标的实现。 4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。 							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，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规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：400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

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

渤海汇金证券资产管理有限公司

二〇二六年三月三十一日