

# 渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金

## 2026 年第 2 季度报告

2026 年 06 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:中泰证券股份有限公司

报告送出日期:2026 年 07 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中泰证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年07月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2026年04月01日起至2026年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 46,894,351.15 份                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 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</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>的新动能主题主要涵盖大力开展技术研发，发展新兴产业，扩大中高端有效供给，创造新的经济增长点以对冲传统经济动能减弱的上市公司，以及在传统产业中利用新技术、新业态进行产业改造，减少低端和无效供给，助力产业结构转型升级的上市公司。</p> <p>本基金拟投资的上市公司主要包括：</p> <p>1) 在前沿创新领域如信息技术、智能技术方面投入较大，形成一定行业竞争优势的科技企业，在申银万国一级行业中相关行业包括：电子、计算机、通信、国防军工；</p> <p>2) 通过发展新型能源、新型材料、新型生产工艺或构造新生产模式，在传统产业中对排放结构进行绿色化、低碳化、循环化的升级，或在传统产业中产业结构方面进行高端化、集群化、品牌化、信息化和智能化等转型的企业，在申银万国一级行业中相关行业包括：电力设备、机械设备、汽车、有色金属、基础化工、公用事业、环保；</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>1、定量分析</p> <p>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。</p> <p>1) 估值水平</p> <p>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。</p> <p>2) 成长性</p> <p>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。</p> <p>3) 运营质量</p> <p>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。</p> <p>2、定性分析</p> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>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。</p> <p>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> <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</p> |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                 |                                                                              |                |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------|----------------|
|                 | 率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时在严格控制风险的情况下，综合运用多个策略和研究方法，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。 |                |
| 业绩比较基准          | 中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*30%                                          |                |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。                                |                |
| 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                                                                   |                |
| 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 | 38,725,106.71 份                                                              | 8,169,244.44 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日） |               |
|-----------------|----------------------------------------|---------------|
|                 | 渤海汇金新动能主题混合 A                          | 渤海汇金新动能主题混合 C |
| 1. 本期已实现收益      | -14,612.90                             | -16,351.89    |
| 2. 本期利润         | -7,306,044.01                          | -1,562,001.57 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.2164                                | -0.1596       |
| 4. 期末基金资产净值     | 45,764,392.85                          | 9,586,486.71  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1818                                 | 1.1735        |

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、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    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -12.94%    | 1.71%         | 41.26%         | 1.69%                 | -54.20% | 0.02% |

|            |        |       |        |       |         |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去六个月      | -7.46% | 1.76% | 37.53% | 1.48% | -44.99% | 0.28% |
| 过去一年       | 10.05% | 1.51% | 82.12% | 1.43% | -72.07% | 0.08% |
| 过去三年       | 28.69% | 1.90% | 75.78% | 1.29% | -47.09% | 0.61% |
| 过去五年       | 5.04%  | 1.69% | 20.19% | 1.20% | -15.15% | 0.49% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.18% | 1.66% | 39.26% | 1.20% | -21.08% | 0.46% |

渤海汇金新动能主题混合 C 净值表现

| 阶段         | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月      | -13.05%    | 1.71%         | 41.26%         | 1.69%                 | -54.31% | 0.02% |
| 过去六个月      | -7.69%     | 1.76%         | 37.53%         | 1.48%                 | -45.22% | 0.28% |
| 过去一年       | 9.49%      | 1.51%         | 82.12%         | 1.43%                 | -72.63% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.12%     | 1.64%         | 88.62%         | 1.31%                 | -56.50% | 0.33% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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-2026年06月30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-2026年06月30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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务                                                   | 任本基金的基金经<br>理期限 |      | 证<br>券<br>从<br>业<br>年<br>限 | 说明                                                                                                                                                                                                                  |
|----|------------------------------------------------------|-----------------|------|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                      | 任职日期            | 离任日期 |                            |                                                                                                                                                                                                                     |
| 何翔 | 公募量化权益部总经理兼<br>公募权益部量化投资团队<br>负责人、量化投资总监，<br>本基金基金经理 | 2021-03-23      | -    | 22<br>年                    | 中国国籍，南开大学数学学士、<br>金融学硕士，具有基金从业资格。<br>2004 年 2 月至 2013 年 10<br>月就职于渤海证券研究所，任<br>金融工程部经理。2013 年 10 月<br>至 2016 年 8 月就职于渤海证券<br>基金管理总部，任投资研究部<br>经理。2016 年 8 月加入渤海汇<br>金证券资产管理有限公司公募<br>投资部，任公募投资总监。现<br>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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金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，为基金份额持有人谋求利益。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的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，A 股市场经历了修复普涨到极致割裂，整体呈现明显的结构分化、波动加剧的特征。4 月伴随地缘风险缓释叠加一季报业绩兑现，市场风险偏好修复，全面回暖。进入 5 月，市场极致定价“产业景气分化”，科技主线强势上涨，传统板块持续承压。而地缘局势反复，美国较强经济数据引发市场对通胀和加息预期的担忧，叠加科技主线较高拥挤度，5 月下旬市场呈现较大幅度的震荡。截至 2026 年 6 月 30 日，二季度上证指数上涨 5.20%、沪深 300 上涨 11.90%、创业板指上涨 36.35%、中证 500 上涨 18.56%、中证 1000 上涨 15.62%、中证 2000 上涨 7.78%。行业方面，二季度表现较好的行业是电子、通信、建筑材料、机械设备、基础化工，表现较弱的行业分别是石油石化、农林牧渔、钢铁、商贸零售、美容护理。

二季度，市场呈现出结构极度分化的割裂现象，市场资金极致抱团科技板块。流动性虹吸效应的冲击下小微盘股遭遇了剧烈的调整，导致新动能基金净值出现一定程度回撤。但我们认为这次调整是市场极致演化的短期现象，这种现象并不会一直持续。市场不会简单重复历史，但却总会押着同样的韵脚，情绪与资金的极致演绎往往凸显了一面是风险，而另一面则是机遇。小微盘股出现了几乎历史最低拥挤度的局面，当下的小微盘策略很可能也是处在一个历史低位区域。我们仍看好小微盘策略中长期收益韧性以及调整后的修复能力，也将积极挖掘和把握被错杀的小微盘股的投资机会。

我们量化小微盘策略本身的魅力正在于利用市场情绪的波动和股票定价的偏差这些市场微观生态来获取投资收益，其实策略本身甚至也可以看做是一种践行格雷厄姆式传统价值投资理念的另类投资策略，人弃我取的逆向投资思路在我们量化小微盘策略里面有着淋漓尽致的体现，那么此次因为市场极致抱团效应造成小微盘股的调整，带来的正是很好的投资机会，这个过程中大量相对便宜或被错杀的小盘股会成为我们量化策略模型“捡烟蒂”的好标的，这正是人弃我取，别人恐惧、我贪婪的好时机。我相信，好的策略是值得去长期坚持的，遇到这样的市场波动，唯有更好的坚持才会有更好的收获。

#### 4.5 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 1.1818 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.94%，同期业绩比较基准收益率为 41.26%；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 1.1735 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-13.05%，同期业绩比较基准收益率为 41.26%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 52,410,402.50 | 93.96         |
|    | 其中：股票             | 52,410,402.50 | 93.96         |
| 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      | 3,197,807.16  | 5.73          |
| 8  | 其他资产              | 172,428.07    | 0.31          |
| 9  | 合计                | 55,780,637.73 | 100.00        |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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         | 27,500.00     | 0.05          |
| B  | 采矿业              | 9,376.00      | 0.02          |
| C  | 制造业              | 40,229,475.58 | 72.68         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 270,444.00    | 0.49          |
| E  | 建筑业              | 15,260.00     | 0.03          |
| F  | 批发和零售业           | 2,083,513.00  | 3.76          |
| 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  | 5,446,717.08  | 9.84          |
| J  | 金融业              | —             | —             |
| K  | 房地产业             | —             | —             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 57,705.00     | 0.10          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 447,982.00    | 0.81          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 3,254,082.84  | 5.88          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —             | —             |
| P  | 教育               | 287,676.00    | 0.52          |

|   |           |               |       |
|---|-----------|---------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作   | 189,819.00    | 0.34  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 90,852.00     | 0.16  |
| S | 综合        | —             | —     |
|   | 合计        | 52,410,402.50 | 94.69 |

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 688659 | 元琛科技 | 78,756  | 822,212.64 | 1.49         |
| 2  | 688026 | 洁特生物 | 50,800  | 798,068.00 | 1.44         |
| 3  | 300126 | 锐奇股份 | 133,100 | 769,318.00 | 1.39         |
| 4  | 300112 | 万讯自控 | 121,900 | 754,561.00 | 1.36         |
| 5  | 002105 | 信隆健康 | 138,800 | 685,672.00 | 1.24         |
| 6  | 600202 | 哈空调  | 151,900 | 680,512.00 | 1.23         |
| 7  | 300665 | 飞鹿股份 | 66,500  | 680,295.00 | 1.23         |
| 8  | 300717 | 华信新材 | 31,600  | 673,080.00 | 1.22         |
| 9  | 688296 | 和达科技 | 58,282  | 666,746.08 | 1.20         |
| 10 | 301126 | 达嘉维康 | 75,500  | 645,525.00 | 1.17         |

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

不适用

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

不适用

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 172,428.07 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 172,428.07 |

**5.11.4 报告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。

**5.11.5 报告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。

**5.11.6 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。

**§ 6 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 |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 30,162,741.05 | 10,132,558.92 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 13,420,964.46 | 6,924,538.41  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 4,858,598.80  | 8,887,852.89  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 38,725,106.71 | 8,169,244.44  |

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。

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况****7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 9,993,786.31  |
| 报告期期间买入/申购总份额            | 3,863,298.29  |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 13,857,084.60 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 29.55         |

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额（份）      | 交易金额（元）      | 适用费率   |
|----|------|------------|--------------|--------------|--------|
| 1  | 申购   | 2026-04-07 | 770,547.69   | 999,400.36   | 0.0006 |
| 2  | 申购   | 2026-06-04 | 1,513,669.61 | 1,998,800.72 | 0.0006 |

|    |    |            |              |              |        |
|----|----|------------|--------------|--------------|--------|
| 3  | 申购 | 2026-06-12 | 1,579,080.99 | 1,998,800.72 | 0.0006 |
| 合计 |    |            | 3,863,298.29 | 4,997,001.80 |        |

注：表中交易日期为确认日。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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              | 20260401-20260630       | 9,993,786.31 | 3,863,298.29 | -    | 13,857,084.60 | 29.55% |
| 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：<br>1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。<br>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。<br>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。<br>4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。 |                |                         |              |              |      |               |        |

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

### 9.3 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

二〇二六年七月二十一日