

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）  
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 2023 年 07 月 18 日起至 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起（FOF）   |
| 场内简称       | -  |
| 交易代码       | 018674   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2023 年 7 月 18 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 11,853,292.95 份  |
| 投资目标       | 在严格控制组合风险的前提下，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产，追求超越基金业绩比较基准的资产长期稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金主要对国内外宏观经济环境、经济周期所处阶段、财政货币政策形势、证券市场走势、市场流动性等因素进行综合分析，判断各大类资产（如权益类、固定收益类、商品类）的中长期风险-收益特征和相对投资价值，结合本基金的投资目标、投资理念和风险控制要求，确定大类资产的中长期配置权重及调整区间。本基金将紧密跟踪市场环境的变化，结合组合绩效归因分析，对资产配置进行适时调整和优化。</p> <p>（二）基金投资策略</p> <p>基金投资策略分为权益类基金投资策略和固定收益类基金投资策略。</p> <p>1、权益类基金投资策略</p> <p>权益类基金包含主动型基金和指数型基金，前者包括股票型基金和混合型基金；后者包含普通指数型基金、增强指数型基金和 ETF。指数型权益</p> |

|  |   |
|--|---|
|  | <p>类基金具有低成本优势,本基金对指数型基金的选择主要从标的基金所跟踪指数的走势研判及特征、跟踪误差、基金规模和流动性四方面来考量。主动型权益类基金的投资,主要运用多维度的基金评价分析方法,精选中长期业绩优秀且具有持续性、投资风格稳定的基金进行投资。</p> <p>定性分析方面通过对基金经理访谈或调研的方式进行,主要从基金产品、投资流程、基金管理团队、风险控制等维度进行评价。</p> <p>定量分析方面包括:</p> <p>(1) 业绩分析:主要包括收益、风险、收益风险比等。</p> <p>(2) 归因分析:主要包括择时能力、行业配置能力、选股能力等。</p> <p>(3) 持仓分析:在行业配置层面,主要观察行业集中度、行业偏离度、行业轮换度等指标。</p> <p>(4) 风险控制能力:主要考察下行标准差、区间最大回撤、信息比率等指标。</p> <p>2、固定收益类基金投资策略</p> <p>固定收益类基金的选择包括定性分析和定量分析两个维度。定性分析方面通过对基金经理访谈或调研的方式进行,主要从基金产品、投资流程、基金管理团队、风险控制等维度进行评价。而定量分析方面,除了分析基金的长中短期投资业绩、收益率波动性、最大回撤、风险调整后收益等指标外,还将分析标的基金的久期、投资杠杆和信用债的投资比例及结构,结合市场利率、收益率曲线和信用利差变动趋势的判断,分析组合的久期、杠杆水平以及信用风险暴露度。</p> <p>(三) 股票投资策略</p> <p>本基金在行业分析的基础上,会更加侧重用自下而上的方法精选个股。通过对上市公司的深度调研和分析,理清发展脉络,发现成长价值,在注重安全边际的基础上挑选具有长期竞争力的优质公司,通过股票池分级管理,精选核心投资标的。重点在于以下几个方面:</p> <p>1、定性分析:包括企业核心竞争优势、公司治理结构、管理层战略规划能力和经营团队管理能力等方面。</p> <p>2、定量分析:包括财务分析、市场占有率、盈利能力和成长能力等。主要参考业务收入增长率、利润增长率、净资产收益率 (ROE)、毛利率等成长和盈利性指标。</p> <p>3、纵向比较:研究行业发展历史和公司发展历史,从而判断公司未来的发展前景。</p> |
|--|---|

|                 |   |                           |
|-----------------|---|---------------------------|
|                 | <p>4、横向比较：对所研究上市公司的竞争对手、上下游关系进行比较分析，从而判断投资标的的价值。</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。本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。</p> <p>可转换债券和可交换债券同时具有债券与权益类证券的双重特性。本基金利用可转换债券及可交换债券的债券底价和到期收益率、信用风险来判断其债性，增强本金投资的安全性；利用可转换债券和可交换债券转股溢价率、基础股票基本面趋势和估值来判断其股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种。</p> <p>综合选择安全边际较高、基础股票基本面优良的品种进行投资，获取超额收益。</p> <p>同时，关注可转债和可交换债流动性、条款博弈、可转债套利等影响转债及可交换债投资的其他因素。</p> <p>（五）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          | 中证 800 指数收益率*80%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%   |                           |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金中基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金中基金。  |                           |
| 基金管理人           | 渤海汇金证券资产管理有限公司  |                           |
| 基金托管人           | 宁波银行股份有限公司  |                           |
| 下属分级基金的基金简称     | 渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起（FOF）A   | 渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起（FOF）C |
| 下属分级基金的场内简称     | -   | -                         |
| 下属分级基金的交易代码     | 018674  | 018675                    |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,851,239.34 份   | 2,053.61 份                |
| 下属分级基金的风险收益特征   | -   | -                         |

### § 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 ( 2023 年 7 月 18 日 — 2023 年 9 月 30 日 ) |                             |
|-----------------|---|-----------------------------|
|                 | 渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起 (FOF) A               | 渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起 (FOF) C |
| 1. 本期已实现收益      | -337,488.14                               | -59.32                      |
| 2. 本期利润         | -755,971.83                               | -131.35                     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0641                                   | -0.0646                     |
| 4. 期末基金资产净值     | 11,092,453.08                             | 1,920.70                    |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9360                                    | 0.9353                      |

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。

#### 3.2 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

渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起 (FOF) A

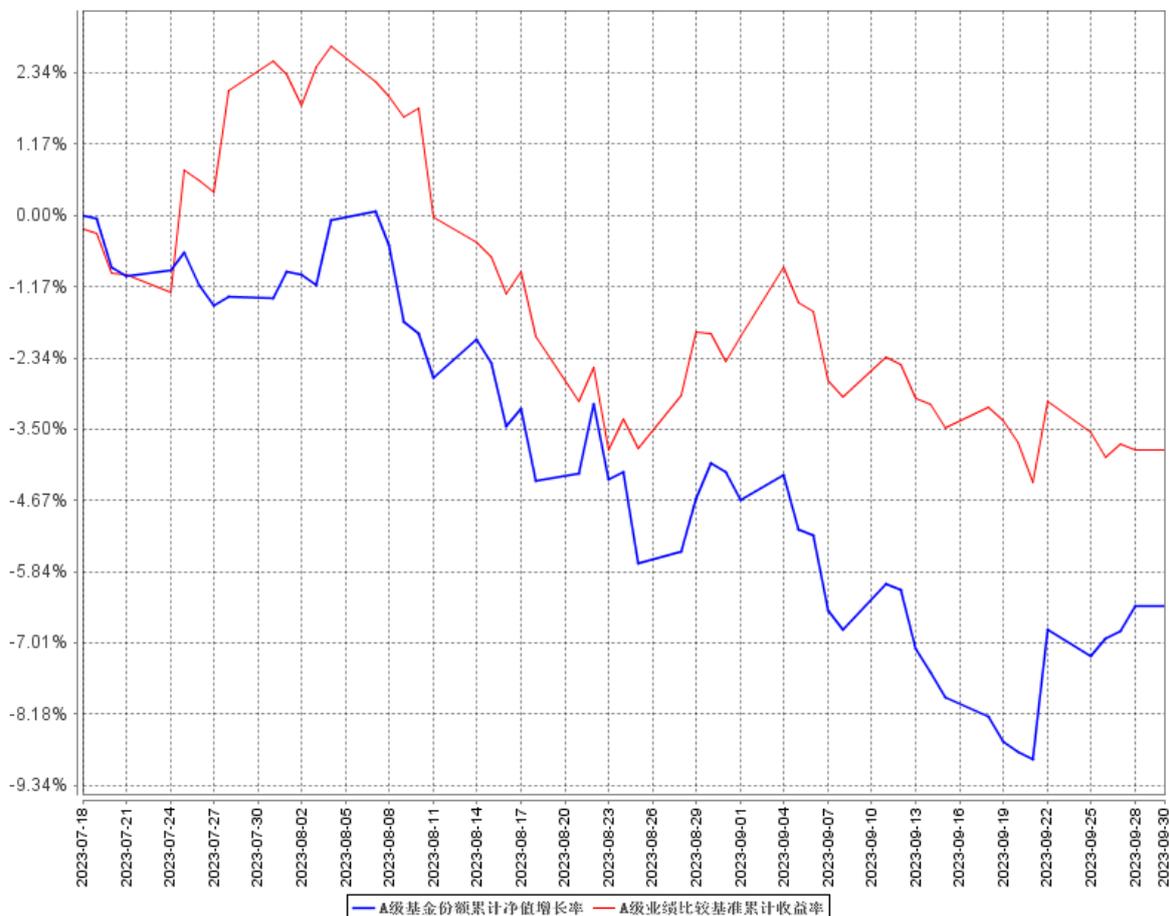
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | -6.40% | 0.70%     | -3.85%     | 0.72%         | -2.55% | -0.02% |

渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起 (FOF) C

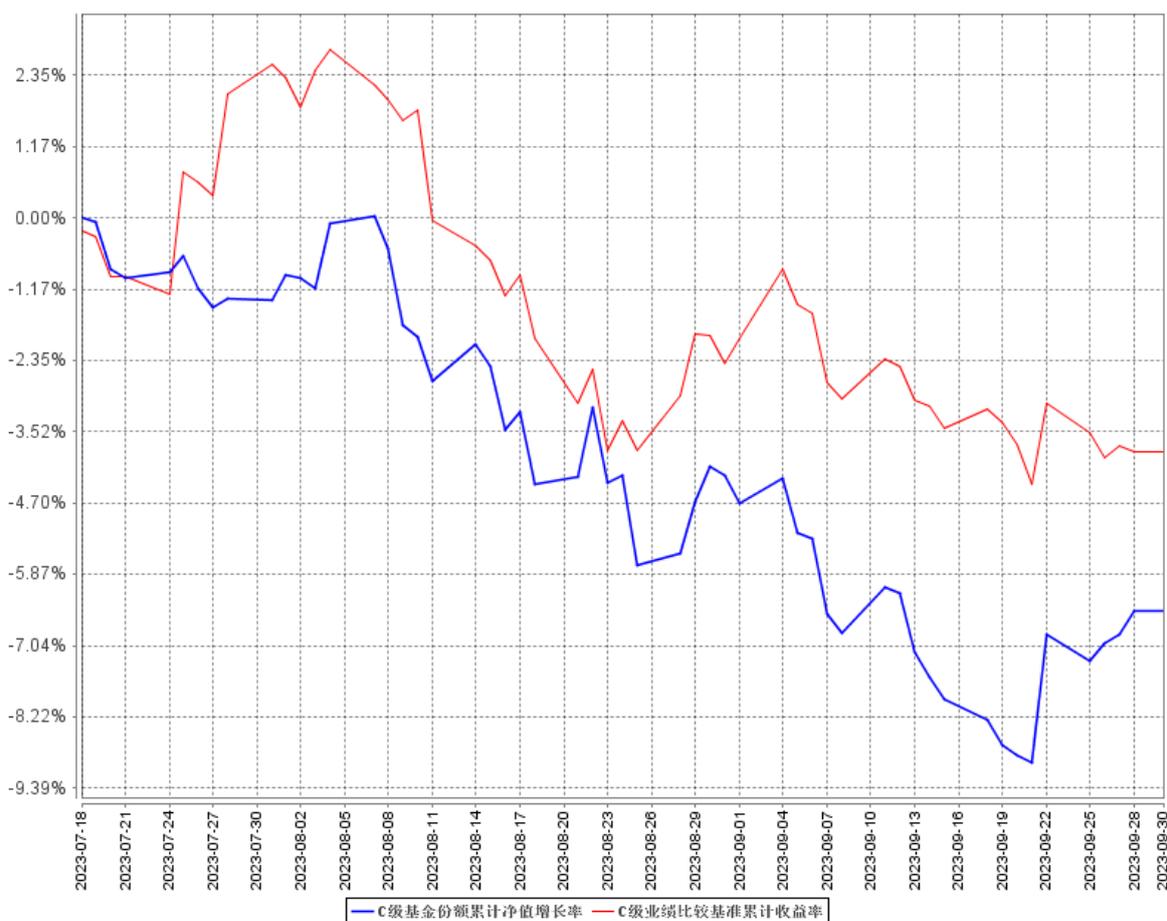
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | -6.47% | 0.70%     | -3.85%     | 0.72%         | -2.62% | -0.02% |

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2023 年 7 月 18 日生效。

2、自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚处于建仓期。

### 3.3 其他指标

## § 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      | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---------|-----------------|------|--------|---|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 叶萌 | 本基金基金经理 | 2023 年 7 月 18 日 | -    | 9 年    | 具有 7 年以上投资、研究经历。曾先后任职于东北证券股份有限公司资产管理总部、东证融汇证券资产管理有限公司、太平洋证券股份 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 有限公司资产管理总部，从事基金产品研究和投资工作。2022 年 7 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司，任资产配置部 FOF 投资总监。2023 年 6 月 12 日担任渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

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

#### 4.1.1 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《渤海汇金优选进取 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

产品成立以来，我们对 AI 产业尤其是基础算力相关板块进行了积极的配置，但总体仓位相对稳健。我们认为 ChatGPT 从横空出世让大家看到了通用大语言模型的巨大进步，未来可能会颠覆性改变我们的生活。结合英伟达过往业绩及业绩指引均超市场预期，我们认为当下投资机会主要集中在基础算力相关，而数据要素、软件应用等板块也将迎来左侧布局的机会，所以我们也做了积极的配置。我们认为 TMT 相关板块的机会会越来越多，也会继续重点关注。特别的是站在四季度初的当下，市场对基础算力相关板块的预期已经体现得较为充分，后续可能会开始分化。其次我们还看好四季度以及明年医药相关板块的一些机会，我们认为 1、利空基本出清，8 月份情绪或见底，9 月份政策或见底，预计基本面也将很快见底，利空出清相对充分；2、比较优势，多数制药公司估值仍处于历史估值中枢之下，主流公司预计业绩增速或将跑赢 GDP，叠加上需求刚性和科技属性可支撑估值，性价比和安全边际显著；3、逻辑通顺，行业“集采出清+新药放量+位置底部”的核心逻辑没有变，中长期胜率够高。

今年可能是基本面快速变化的一年，我们认为主要集中在成长股的产业趋势上。随着政策的持续发力，对市场积极影响的力度空前，投资回归基本面大概率已经不远。我们将继续持续关注市场变化，以适应快速变化的产业趋势。

本基金是一只进取型的普通 FOF 产品，权益类资产的配置中枢为 80%，通过寻找高景气产业方向，对组合进行积极的战略配置，战术上则兼顾底层基金的超额能力以及横向比较更具优势的相关标的。在组合管理的过程中，保持策略的稳定性，兼顾长期收益率和持续提升持有人体验，从而陪伴投资者实现财富增值。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起 (FOF) A 基金份额净值为 0.9360 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.40%；截至本报告期末渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起 (FOF) C 基金份额净值为 0.9353 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.47%；同期业绩比较基准收益率为-3.85%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募

集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## § 5 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              | -             | -             |
|    | 其中：股票             | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | 7,560,935.41  | 68.02         |
| 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          | -3,305.21     | -             |
|    | 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      | 3,557,521.46  | 32.01         |
| 8  | 其他资产              | 29.98         | 0.00          |
| 9  | 合计                | 11,115,181.64 | 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

不适用

#### 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出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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 本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况

本基金本报告期内未持有股票，故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

### 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   | 29.98 |
| 6  | 其他应收款   | -     |
| 7  | 其他      | -     |
| 8  | 合计      | 29.98 |

注：本基金本报告期末无其他资产。

### 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：本基金本报告期末未持有股票。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 基金中基金

### 6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称               | 运作方式 | 持有份额<br>(份) | 公允价值<br>(元) | 占基金资产<br>净值比<br>例 (%) | 是否属<br>于基金<br>管理人<br>及管理<br>人关联<br>方所管<br>理的基<br>金 |
|----|--------|--------------------|------|-------------|-------------|-----------------------|--|
| 1  | 001144 | 大成互联网思维混合 A        | -    | 541,316.83  | 846,619.52  | 7.63                  | 否  |
| 2  | 000828 | 宏利转型机遇股票 A         | -    | 393,568.93  | 788,318.57  | 7.11                  | 否  |
| 3  | 588080 | 易方达上证科创板 50 成份 ETF | -    | 850,000.00  | 772,650.00  | 6.96                  | 否  |
| 4  | 511660 | 建信现金添益交易货币 H       | -    | 7,525.00    | 752,913.88  | 6.79                  | 否  |
| 5  | 511360 | 海富通中证短融 ETF        | -    | 6,900.00    | 745,193.10  | 6.72                  | 否  |
| 6  | 720001 | 财通价值动量混合           | -    | 226,372.49  | 696,774.52  | 6.28                  | 否  |
| 7  | 006887 | 诺德新生活混合 A          | -    | 567,118.70  | 631,259.82  | 5.69                  | 否  |
| 8  | 501219 | 华夏智胜先锋股票 (LOF) A   | -    | 500,000.00  | 569,750.00  | 5.14                  | 否  |
| 9  | 588000 | 华夏上证科创板 50 成份 ETF  | -    | 550,000.00  | 512,600.00  | 4.62                  | 否  |
| 10 | 159739 | 鹏华中证云计算与大数据主题 ETF  | -    | 550,000.00  | 510,950.00  | 4.61                  | 否  |

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用<br>2023 年 7 月 18 日 — 2023 年 9 月 30 日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|---|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元）      | 6,752.06                                  | -                               |
| 当期交易基金产生的赎回费（元）      | 1,878.98                                  | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 375.65                                    | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 9,411.82                                  | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 1,769.60                                  | -                               |
| -                    | -   | -                               |

## 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会等重大影响事项。

注：无

## § 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                    | 渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起 (FOF) A | 渤海汇金优选进取 6 个月持有混合发起 (FOF) C |
|---------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 基金合同生效日 ( 2023 年 7 月 18 日 )<br>基金份额总额 | 11,554,624.06               | 2,032.05                    |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额                 | 296,615.28                  | 21.56                       |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额               | -                           | -                           |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 ( 份额减少以“-”填列 ) | -                           | -                           |
| 报告期期末基金份额总额                           | 11,851,239.34               | 2,053.61                    |

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。

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 基金合同生效日管理人持有的本基金份额        | 10,000,450.05 |
| 基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额    | 0.00          |
| 基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额    | 0.00          |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额          | 10,000,450.05 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 84.37         |

注：本基金合同于 2023 年 7 月 18 日生效。

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

## § 9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限    |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|---------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,450.05 | 84.37            | 10,000,450.05 | 84.37            | 自合同生效之日起不少于三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 199,889.08    | 1.69             | -             | -                | -             |
| 基金经理等人员     | 1,000,230.41  | 8.44             | -             | -                | -             |
| 基金管理人股东     | -             | -                | -             | -                | -             |
| 其他          | -             | -                | -             | -                | -             |
| 合计          | 11,200,569.54 | 94.49            | 10,000,450.05 | 84.37            | 自合同生效之日起不少于三年 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 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              | 20230718-20230930       | 10,000,450.05 | 0.00 | 0.00 | 10,000,450.05 | 84.37% |
| 个人   | -              | -                       | -             | -    | -    | -             | -      |
| -  | -              | -                       | -             | -    | -    | -             | -      |
| 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"> <li>1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。</li> </ol> |                |                         |               |      |      |               |        |

### 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2023 年 9 月 21 日发布公告，自 2023 年 9 月 19 日起，齐朝晖先生代任渤海汇金证券资产管理有限公司的总经理，原总经理麻众志先生离任。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金优选进取 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）设立的文件；
- 2、《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）基金合同》；
- 3、《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）托管协议》；
- 4、《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）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、渤海汇金优选进取 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）在指定报刊上的各项公告。

## 11.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

## 11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

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

渤海汇金证券资产管理有限公司

2023 年 10 月 25 日