

渤海汇金创新价值一年持有期混合型 发起式证券投资基金清算报告

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年9月9日

清算报告公告日：2024年9月13日

§ 1 重要提示

渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金（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〔2021〕1340号《关于准予渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册。经向中国证监会备案，《渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于2021年8月31日正式生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规规定及《基金合同》约定，《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

本基金《基金合同》生效日为2021年8月31日，《基金合同》生效之日起三年后的对应日为2024年8月31日。截至2024年8月31日，本基金的基金资产净值低于2亿元，已触发上述《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，基金管理人将根据相关法律法规、《基金合同》等规定对本基金进行清算，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人于2024年8月31日披露了《关于渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金从2024年9月1日起进入清算期，由基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司、基金托管人浙商银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成了基金财产清算小组，履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金概况

基金名称	渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金
基金简称	渤海汇金创新价值一年持有期混合
基金主代码	012272
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2021年08月31日
基金最后运作日(2024年8月31日) 基金份额总额	19,753,695.28份
投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过积极主动的资产配置和投资管理,优选具有创新和商业价值转化能力的细分领域高成长龙头,追求超越基金业绩比较基准的中长期资产增值。
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) 股票投资策略</p> <p>本基金将通过对公司的深度调研和分析,从成长属性和竞争优势两个维度寻找投资标的,同时根据行业发展阶段、周期和政策等要素的分析,对于行业景气度的变化进行分析,将行业分析与个股精选相结合,寻找具有投资价值的细分行业和上市公司。</p> <p>1、精选个股:通过对企业核心竞争力、公司治理、经营管理能力和企业估值分析等方面的研究,对公司所处的行业地位、盈利能力和成长能力做出判断,结合利润增长率、投资资本回报率等财务指标,筛选出盈利能力超过市场平均水平的上市公司。</p> <p>2、行业配置:根据中国经济结构调整的方向,对宏观经济环境、产业政策和行业竞争格局等因素进行分析,判断各行业的景气度变化、相对投资价值与风险收益情况。</p> <p>3、新股申购:本基金将在审慎原则下积极参与一级市场新股申购。通过研究首次公开发行股票及增发新股的上市公司基本面因素,分析新股内在价值、市场溢价率、中签率和申购机会成本等综合评估申购收益率,从而制定相应的申购策略以及择时卖出策略。</p> <p>(三) 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。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。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</p>

	<p>可交换债投资的其他因素。</p> <p>（四）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。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>（五）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过研究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 500 指数收益率*75%+中债综合全价(总值)指数收益率*25%
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	浙商银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可（2021）1340号《关于准予渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由渤海汇金证券资产管理有限公司管理，并依照法律法规、《基金合同》等规定自2021年8月9日至2021年8月27日公开募集。《基金合同》于2021年8月31日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额（含利息结转份额）总额为133,962,066.20份。

自2021年8月31日至2024年8月31日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》等有关规定，基金管理人于2024年8月31日披露了《关于渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金最后运作日为2024年8月31日，自2024年9月

1 日起，本基金进入基金财产清算程序。

§ 4 财务会计报告

4.1 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 8 月 31 日

单位：人民币元

	最后运作日 2024 年 8 月 31 日
资产：	
货币资金	7,371,488.72
交易性金融资产	5,826,291.00
其中：股票投资	5,826,291.00
资产总计	13,197,779.72
负债和净资产	
负债：	
应付赎回款	3,832,354.45
应付管理人报酬	27,597.77
应付托管费	4,599.62
负债合计	3,864,551.84
净资产：	
实收基金	19,753,695.28
未分配利润	-10,420,467.40
净资产合计	9,333,227.88
负债和净资产总计	13,197,779.72

注：截至最后运作日 2024 年 8 月 31 日，基金份额净值 0.4725 元，基金份额总额 19,753,695.28 份。

§ 5 清算情况

清算期间自 2024 年 9 月 1 日至 2024 年 9 月 9 日止，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及清算期间的清算损益情况如下：

5.1 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定，清算费用应由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的清算律师费由基金管理人承担。

5.2 资产处置情况

5.2.1 本基金最后运作日货币资金人民币 7,371,488.72 元，其中存放于渤海证券股份有限公司证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金为人民币 7,360,580.20 元，对应应计利息为 10,908.52 元。上述货币资金在清算期间已完成结息并划转至银行托管户。

5.2.2 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 5,826,291.00 元，全部为股票投资。该资产已于清算期全部变现，变现所产生的证券清算款为人民币 5,765,036.03 元，该款项已于 2024 年 9 月 3 日划入托管户。

5.3 负债清偿情况

5.3.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 3,832,354.45 元，该款项已于 2024 年 9 月 4 日支付完毕。

5.3.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 27,597.77 元，该款项已于 2024 年 9 月 2 日支付。

5.3.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,599.62 元，该款项已于 2024 年 9 月 2 日支付。

5.4 清算期间的损益情况

单位：人民币元

项目	金额
一、清算期间收益	-65,503.85
1、利息收入（注 1）	440.16
2、投资收益（注 2）	-26,231.28
3、公允价值变动损益	-39,712.73
二、清算期间费用	-
三、清算期间净收益	-65,503.85

注：1) 利息收入为自 2024 年 9 月 1 日至 2024 年 9 月 9 日止清算期间的货币资金利息收入。

2) 投资收益为自 2024 年 9 月 1 日至 2024 年 9 月 9 日止清算期间的股票变现收益。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 8 月 31 日基金净资产	9,333,227.88
加：清算期间净收益	-65,503.85
减：基金净赎回金额（于 2024 年 9 月 2 日确认的投资者赎回申请）	1,861,991.81
二、清算结束日 2024 年 9 月 9 日基金净资产	7,405,732.22

资产处置及负债清偿后，本基金 2024 年 9 月 9 日归属于剩余基金份额持有人的基金净资产为人民币 7,405,732.22 元，其中剩余未到账资产为人民币 222.85 元，均为货币资金应计利息。支付清算款之日前未到账的部分，将由基金管理人以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

自清算期结束日次日（2024年9月10日）至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的货币资金孳生的利息归基金份额持有人所有，最终支付清算款金额以本基金登记机构的记录为准。基金管理人垫付的资金自资金到账日起至托管账户销户为止孳生的利息归基金管理人所有，在托管账户销户前向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

5.6 基金财产清算报告的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时进行分析。

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、《渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金清算财务报表及审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于〈渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金清算报告〉的法律意见》

6.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

6.3 查阅方式

上述文件可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>

渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2024年9月9日