

渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金  
2024 年第 3 季度报告

2024 年 09 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:招商证券股份有限公司

报告送出日期:2024 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024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2024年07月01日起至2024年09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	渤海汇金低碳经济一年持有期混合发起
基金主代码	016700
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年11月29日
报告期末基金份额总额	24,309,610.04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，优选受益于全球碳减排浪潮的行业和公司，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>本基金将综合考虑国内宏观经济、财政货币政策、国家产业政策、市场流动性以及国际局势影响等方面的因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。</p> <p>（二）低碳经济主题界定</p> <p>为应对全球气候变化的严峻局势，促进碳减排实现碳中和已经成为全球共识，去年以来，全球越来越多的国家提出碳中和目标。我国对外宣布，将二氧化碳排放力争于2030年前达到峰值，努力争取2060年前实现碳中和。碳中和是指产生的二氧化碳排放量与碳汇等形式的吸收量完全抵消，使整体的二氧化碳总量达到平衡不增加的状态。碳中和代表了人类经济生活向绿色低碳转型的大方向，意味着</p>

	<p>生产方式、能源系统和生活方式的变革。实现“碳达峰、碳中和”的目标，事关经济社会发展全局和长期战略，而在实现碳中和的过程中，也将带来新的经济增长点，相关行业领域孕育着巨大的投资机会。</p> <p>本基金为低碳经济主题基金，投资范畴将重点配置于符合全球碳中和发展目标，受益于全球碳减排浪潮的行业和领域：</p> <p>1、低碳技术应用领域：当前技术水平下，能源和工业领域的碳中和转型成本高，需要通过技术降本，实现碳达峰的时间进度依赖节能减排技术的应用，通过信息化和网络化的管理手段，降低能量转化过程中的损耗，提升利用效率，通过构建工业互联网、能源互联网和自动化管理等技术手段，可以为企业助力完成减碳目标，涉及到的行业包括电子、计算机和通信。</p> <p>电子行业主要投资于与低碳技术应用相关的半导体、元器件、光学电子和电子化学品。</p> <p>通信行业主要投资于工业和能源互联网的相关标的。</p> <p>计算机行业主要投资于助力工业领域低碳转型的专业应用软件、网络安全设备与服务。</p> <p>2、绿色能源转型领域：我国的能源结构以煤炭为主，石油、天然气和非化石能源为辅的供应体系，优化能源供给结构，发展绿色能源供应体系是实现低碳经济的关键。电力设备和公用事业行业是能源供给过程中涉及到的两大行业，通过可再生能源对传统能源的替代，实现能源输出的绿色转型。</p> <p>电力设备行业主要投资于风电设备、光伏发电设备和电网设备。</p> <p>公用事业行业主要投资于新能源发电及服务。</p> <p>3、绿色交通运输领域：随着国内汽车保有量的快速增长，交通运输领域的碳排放上行压力较大，电动化、智能化、轻量化是汽车行业未来的发展趋势，经过几年的发展，中国的乘用车实现碳中和的路径也逐渐清晰，相关企业在产业链的优势有望助推中国乘用车行业快速实现绿色转型。</p> <p>新能源汽车产业链包括上游资源、电池材料、电芯、功率半导体、汽车零部件、整车制造、自动化设备等，涉及汽车、电力设备、有色金属、机械等行业。</p> <p>汽车行业主要投资于新能源整车厂、零部件及后市场服务。</p> <p>电力设备行业主要投资于动力电池和储能电池。</p> <p>有色金属行业主要投资于电池材料上游的能源金属（镍、钴、锂等）、金属新材料（磁材）、工业金属和稀土。</p> <p>机械设备行业主要投资于新能源车产业链中的自动化设备和专用设备。</p> <p>4、低碳生活方式领域：消费是碳排放的终端，实现碳达峰</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>和碳中和需要全社会的共同努力，生活方式和消费行为也会出现变化，涉及的行业包括家电、建筑建材和环保行业。</p> <p>家电行业主要投资于智能家居、节能家电。</p> <p>建筑建材行业主要投资于以降低行业碳排放为目标的专业工程公司、风电叶片材料、防水材料（BIPV 应用）、环保涂料。</p> <p>环保行业主要投资于水、固废和生活垃圾治理。</p> <p>5、工业生产制造降碳领域：制造业是非电碳排放的主要来源，未来随着火电被绿色电力替代，工业制造领域所产生的非电碳排放将占据主导地位，需要通过行业自身的技术路线变革或碳捕捉，实现行业碳减排的目标，钢铁、煤炭、水泥、化工和有色金属是制造业碳排放的主要领域。钢铁行业主要投资于汽车轻量化相关的板材和特种钢材。煤炭行业主要投资于通过技术改造在生产过程中有效降低碳排放的公司。</p> <p>化工行业主要投资于应用在新能源领域的化学原料、制品以及非金属材料。</p> <p>本基金投资的以低碳经济为主题的行业和公司未来可能随着技术的发展和产业结构的变化出现差异，主题的涵盖范畴将会发生变化，本基金将视实际情况，在履行适当程序后，调整上述对低碳经济主题类股票的识别及认定，并在招募说明书更新中公告。</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> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol> <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</p>
--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>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）股指期货、国债期货投资策略</p> <p>本基金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>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，提高投资效率。</p> <p>（六）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	中证内地低碳经济主题指数收益率*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，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	招商证券股份有限公司

### § 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（2024年07月01日-2024年09月30日）
1. 本期已实现收益	-8,336,289.44
2. 本期利润	1,944,482.58
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0772

4. 期末基金资产净值	14,031,983.15
5. 期末基金份额净值	0.5772

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

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
过去三个月	16.18%	1.93%	14.99%	1.41%	1.19%	0.52%
过去六个月	-1.64%	1.81%	8.71%	1.21%	-10.35%	0.60%
过去一年	-21.18%	1.92%	0.91%	1.19%	-22.09%	0.73%
自基金合同生效起至今	-42.28%	1.57%	-19.28%	1.11%	-23.00%	0.46%

#### 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

渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年11月29日-2024年09月30日)



注：1、本基金合同于 2022 年 11 月 29 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。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 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		
滕祖光	公募权益部主动权益团队负责人、权益投资副总监，本基金基金经理	2022-11-29	-	16年	滕祖光先生，中央财经大学经济学硕士。曾先后任职于国家开发投资公司、国金基金管理有限公司，先后担任交易员、高级交易员、行业研究员、基金经理等职务。2020年7月加入渤海汇金证券资产管理有限公司，现任公募权益部主动权益团队负责人、权益投资副总监。2021年8月至2024年8月任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经理。2022年11月起任渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金基金经理。2024年7月起任渤海汇金优选价值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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基

金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 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

三季度国内 A 股市场整体呈现震荡下跌后触底反弹的走势，9 月中旬之前表现为缩量阴跌，季度末最后几个交易日大幅反弹，国内主要指数均上涨，红利指数上涨 4.10%，上证综指上涨 12.44%，深证成指上涨 19.00%，中证 500 指数上涨 16.19%，中证 1000 指数上涨 16.60%。行业方面，申万一级行业指数中非银金融、房地产、商贸零售、社会服务、计算机、传媒和电力设备涨幅超过 20%，尤其受到市场风险偏好正反馈影响较大的券商股，整体涨幅超过 40%，煤炭、石油石化、公用事业等前期表现较好的板块，在市场反弹过程中明显滞后。

本基金在报告期末提高了股票仓位至 90% 以上，基金净值依然上涨了 16.18%，归因分析看，业绩贡献主要产生于电力设备（光伏设备和锂电池）、机械设备（人形机器人）和汽车零部件，在行业配置方面小幅增持了计算机软件、电子、养殖和工程机械，目前持仓配置中以电力设备、机械设备、汽车为主，组合的行业配置比照上期增加了锂电池和机械设备的持仓比重。

季度末政策层面和市场流动性都出现了较好的变化，国新办发布会和政治局会议对于政策层面宽松的表态，在一定程度上缓解了市场对于宏观经济的悲观预期，股票估值得以大幅修正，市场表现为前期超跌的行业和个股反弹力度更强，国内 A 股市场进入“政策底”进一步明晰的拐点阶段，未来随着宏观经济数据筑底，行业和企业盈利将得到修复。国内 A 股市场已经持续了两年多的震荡下跌走势，对于不利因素已经充分消化，未来继续探底的可能性不大。同时，考虑到近期市场出现的股指大幅上涨和成交量显著放大，短期走势或出现较大波动，反弹第一阶段的特征是超跌板块的估值修复，后期将进入到业绩兑现阶段，景气度向上和业绩成长属性强的行业和个股将会有显著的超额收益。对于低碳经济的投资方向依然中长期看好，本基金也将重点配置于相关的行业领域，短期的资产配置策略会相对灵活，会根据市场的走势变化设置部分交易性仓位，以期在市场大幅波动



过程中控制基金净值的回撤幅度。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末渤海汇金低碳经济一年持有期混合发起基金份额净值为 0.5772 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 16.18%，同期业绩比较基准收益率为 14.99%。

#### 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	13,102,975.08	91.98
	其中：股票	13,102,975.08	91.98
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	1,142,117.22	8.02
8	其他资产	998.80	0.01
9	合计	14,246,091.10	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	663,100.00	4.73
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,574,035.08	82.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	464,800.00	3.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	401,040.00	2.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,102,975.08	93.38

#### 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	300274	阳光电源	8,800	876,304.00	6.25
2	300750	宁德时代	3,300	831,237.00	5.92
3	688408	中信博	9,027	757,906.92	5.40
4	688503	聚和材料	18,000	646,200.00	4.61
5	300693	盛弘股份	22,911	631,427.16	4.50
6	002896	中大力德	18,000	574,200.00	4.09
7	603662	柯力传感	18,000	573,120.00	4.08
8	605117	德业股份	5,000	508,400.00	3.62
9	601058	赛轮轮胎	30,000	481,200.00	3.43
10	601865	福莱特	23,000	465,060.00	3.31

#### 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

无

#### 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

无

### 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

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。

**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	998.80
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	998.80

**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**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

报告期期初基金份额总额	25,685,720.62
报告期期间基金总申购份额	863,353.79
减：报告期期间基金总赎回份额	2,239,464.37
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	24,309,610.04

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	10,000,450.05
报告期期间买入/申购总份额	-
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	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 (%)	41.14

## 7.2 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。

## § 8 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	41.14%	10,000,450.05	41.14%	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	69,955.27	0.29%	-	-	-
基金经理等人员	438,962.50	1.81%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,509,367.82	43.23%	10,000,450.05	41.14%	-

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。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	20240701-20240930	10,000,450.05	-	-	10,000,450.05	41.14%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。由此可能导致的特有风险主要包括：							

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

## 9.2 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。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金设立的文件；

- 2、《渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、渤海汇金低碳经济一年持有期混合型发起式证券投资基金在规定报刊上的各项公告。

### 10.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

### 10.3 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

二〇二四年十月二十五日