渤海汇金鑫享债券型发起式证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 10 月 27 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026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2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	渤海汇金鑫享债券发起
基金主代码	026216
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 06 月 16 日
报告期末基金份额总额	63,072,797.69 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略 本基金的资产配置策略以基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主，重点关注包括 GDP 增速、投资增速、货币供应、通胀率和利率等宏观和政策指标，同时结合定量分析的方法，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2、固定收益品种投资策略 本基金根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对行业周期、公司的研究，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在利率债、信用债、可转债等固定收益资产上的比例，寻找各类债券的投资机会。

	（1）利率债投资策略 本基金将及时跟踪影响市场资金供给与需求的关键变量，通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，灵活调整利率债的久期。如果预期利率下降，本组合将增加组合的久期，以较多地获得债券价格上涨带来的收益；反之，如果预期利率上升，本组合将缩短组合的久期，以减小债券价格下跌带来的风险。 （2）信用债投资策略（适用于资产支持证券，下同） 本基金的信用策略强调公司价值挖掘的重要性，在个券的选择上特别重视信用风险的评估和防范。根据经济形势，分析信用债券发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评估债券发行人的信用风险，确定信用债券的信用风险利差，在有效控制信用风险的条件下，积极配置具有估值优势、基本面改善的公司，采取分散策略，重点布局优势债券，争取提高组合超额收益空间。 本基金将投资于信用评级为 AA+及以上的信用债，主要采用债项评级，短期融资券、超短期融资券、债项评级仅有短期债项评级及无债项评级的投资品种参照主体评级。其中：AA+评级债券投资占比不超过本基金投资信用债资产的 50%；AAA 及以上评级债券投资占比不低于本基金投资信用债资产的 50%。 信用评级的认定参照基金管理人认可的评级机构出具的信用评级（不含中债资信评级）。 基金持有信用债期间，如果其信用等级下降、基金规模变动、变现信用债支付赎回款项等使得投资比例不再符合上述约定，应在评级报告发布之日或不再符合上述约定之日起 3 个月内调整至符合规定。所指信用债包括金融债（不包括政策性金融债）、公司债、企业债、政府支持债券、政府支持机构债券、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券等。 （3）可转换债券投资策略 本基金的可转债的投资采取基本面分析和量化分析相结合的方法。重视对可转债对应股票的分析与研究。选择公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种进行投资。在基本面分析的基础上，综合分析可转债的债性特征、股性特征等因素，结合各种定价模型和规范化估值工具，对可转债的价值进行估算，选择价值低估的可转换债券进行投资。 （4）可交换债券投资策略 可交换债券的价值取决于其股权价值、债券价值以及内嵌期权价值。其中其债券价值与可转换债券相同，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而其股权价值则需要关注发行人持有的其他上市公司（目标公司）的股票价值。本基金将结合对可交换债券的纯债部分价值以及对目标公司的股票价值的综合评估，选择具有较高投资价值的可

	交换债券进行投资。 3、股票投资策略 本基金对股票的投资，以价值投资理念为导向，采取“自上而下”和“自下而上”相结合的方法，灵活运用多种低风险投资策略，深度挖掘经济结构转型过程中具有核心竞争力和发展潜力的行业和公司，把握市场定价偏差带来的投资机会。 （1）行业配置策略 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。 （2）个股选择策略 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。 （3）港股通标的股票投资策略 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，将重点关注相对 A 股有稀缺性的行业与个股或具有显著的估值优势的公司，优选持续创造利润能力强、业绩增长潜力大、具有市场竞争优势的港股通标的股票。 本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。 4、存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略，在深入研究的基础上，进行存托凭证的投资。 5、基金投资策略 本基金可投资于全市场的股票型 ETF、基金管理人旗下的股票型基金及应计入权益类资产的混合型基金。对于不同类别的公募基金，本基金将分别按照不同的指标进行筛选，其中：对于被动型基金，本基金将综合考虑运作时间、基金规模、流动性、跟踪误差以及费率水平等指标，筛选出跟踪误差较小、流动性较好、运作平稳、费率水平合理的被动型基金纳入标的基金池。 对于主动管理的公募基金，本基金通过基金评价研究机构推荐、量化指标筛选打分等一种或多种方法，进行初步分析，获得候选基金池。在候选基金池范围内，从多维度对待选投资标的进行定性分析，并做出最终的投资决策。 6、国债期货交易策略 本基金将认真研究国债期货市场运行特征，根据风险管理的原则以套期保值为目的，使用该类交易工具，提高组合收益。 7、信用衍生品投资策略 本基金将根据风险管理原则，以风险对冲为目的参与信用衍

	生品交易。本基金将根据所持债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。 未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书中更新。	
业绩比较基准	中债-新综合全价(总值)指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+活期存款基准利率×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金可以投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	渤海汇金证券资产管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	渤海汇金鑫享债券发起 A	渤海汇金鑫享债券发起 C
下属分级基金的交易代码	026216	026217
报告期末下属分级基金的份额总额	42,822,361.46 份	20,250,436.23 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 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	渤海汇金鑫享债券发起 A	渤海汇金鑫享债券发起 C
1.本期已实现收益	273,858.60	202,428.05
2.本期利润	126,189.61	103,794.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0027	0.0029
4.期末基金资产净值	42,853,184.70	20,253,314.75
5.期末基金份额净值	1.0007	1.0001

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

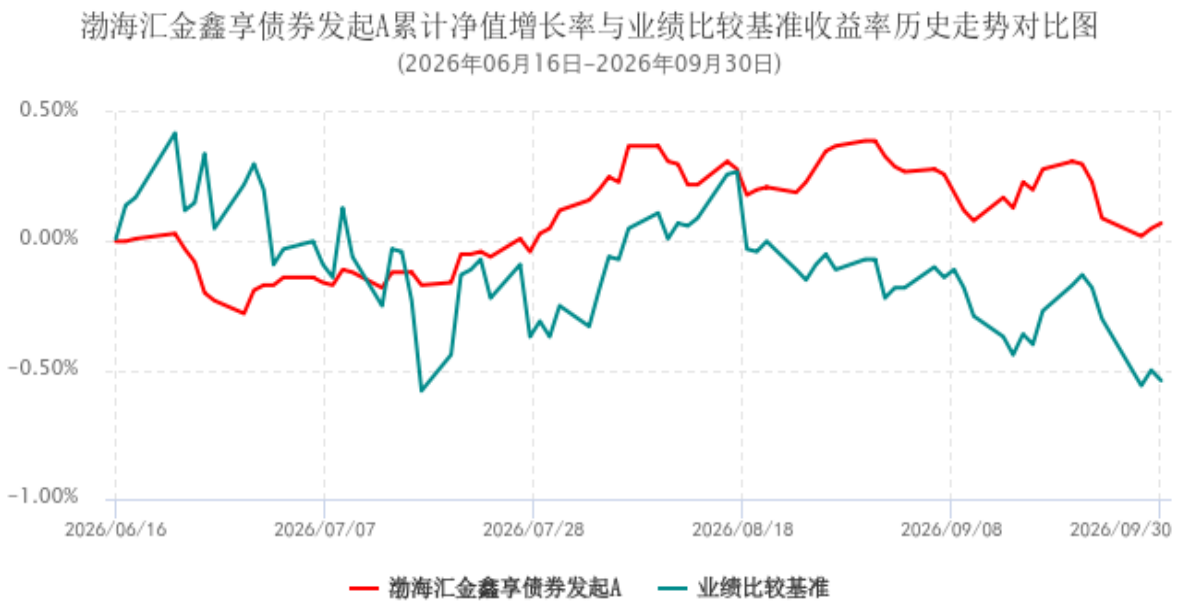
渤海汇金鑫享债券发起 A 净值表现

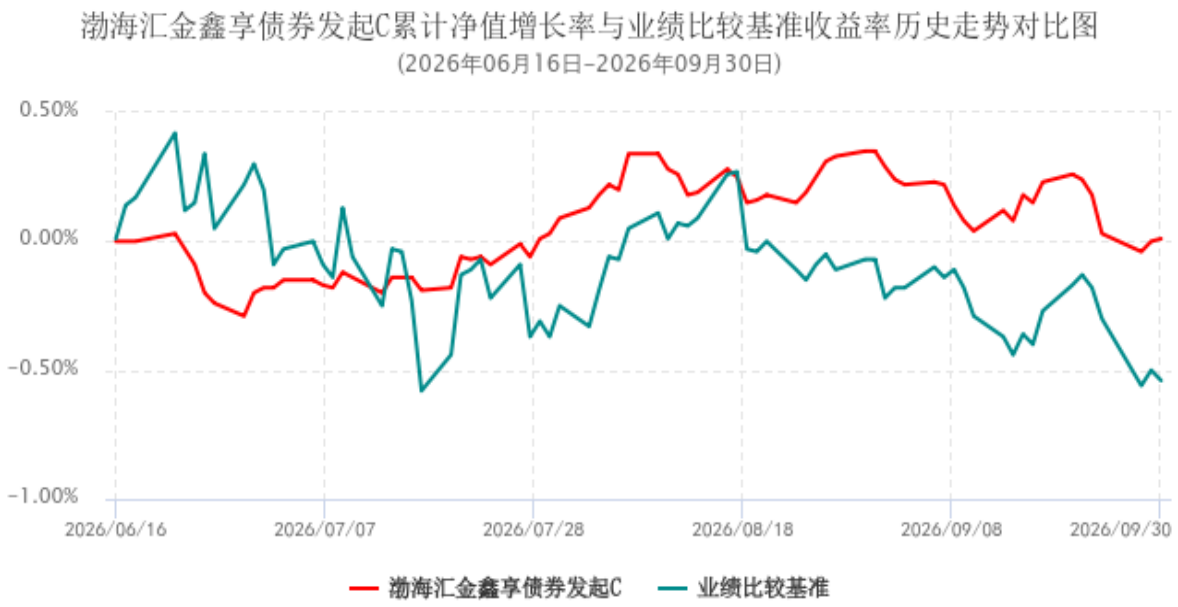
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.26%	0.05%	-0.83%	0.13%	1.09%	-0.08%
自基金合同生效起至今	0.07%	0.05%	-0.54%	0.14%	0.61%	-0.09%

渤海汇金鑫享债券发起 C 净值表现

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	0.21%	0.05%	-0.83%	0.13%	1.04%	-0.08%
自基金合同生效起至今	0.01%	0.06%	-0.54%	0.14%	0.55%	-0.08%

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





注：1、本基金合同于 2026 年 06 月 16 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。

§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		
张旭东	公募固收部信用投资团队负责人兼固收投资总监，暂代利率投资团队负责人，固收增强投资团队负责人，本基金基金经理	2026-06-16	-	15 年	中国国籍，北京航空航天大学硕士，具有基金从业资格。曾任职于中航证券有限公司资产管理分公司、齐鲁证券有限公司北京证券资产管理分公司，方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司。2021 年 4 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司，现任公募固收部信用投资团队负责人兼固收投资总监，暂代利率投资团队负责人，固收增强团队负责人，主要从事资金管理、债券交易以及固定收益投资管理工作。

					2022 年 11 月起任渤海汇金 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 1 月起任渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 6 月起任渤海汇金 2 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金。2024 年 9 月起担任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 6 月起任渤海汇金鑫享债券型发起式证券投资基金基金经理。
刘德杰	本基金基金经理	2026-06-16	-	11 年	中国国籍，对外经济贸易大学本科学历，具有基金从业资格。2012 年 7 月至 2015 年 5 月就职于中国中纺集团公司期货部，从事期货策略研究等工作。2015 年 5 月至 2021 年 1 月就职于信达证券股份有限公司，从事投资助理工作。2021 年 1 月至 2024 年 6 月就职于华金证券股份有限公司，从事资管产品投资经理工作。2024 年 6 月加入渤海汇金资产管理有限公司，现任公募固收部信用投资团队基金经理。2025 年 7 月起任渤海汇金鑫泉平衡混合型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 1 月起担任渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 6 月起任渤海汇金鑫享债券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《渤海汇金鑫享债券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，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 032 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，国内债券市场收益率整体呈现震荡分化走势：短端品种震荡偏弱，长端收益率连创年内新低，收益率曲线逐步平坦化，信用利差收窄至历史低位。

具体来看，7 月债券市场维持区间震荡格局，债市围绕资金面与政策预期波动。跨季后资金面边际转松，理财机构加大短端信用债配置力度，短端品种率先获得支撑，短端信用利差被动压缩。7 月下旬，“存款降息”预期叠加政治局会议释放宽松信号，推动收益率破位下行，做多情绪快速发酵，长端收益率突破前期震荡区间，打开下行通道。8 月长端行情延续走强。8 月上旬长端利率债延续 7 月下旬的强势表现，做多行情进一步深化，10 年期国债收益率、30 年期国债收益率分别触及 1.6645%、2.146%的年内低点。8 月下旬止盈情绪升温，叠加出口数据表现韧性、输入性通胀预期小幅抬头，债市出现阶段性回调，收益率从年内低点小幅回弹。9 月市场整体延续强势，上旬 10 年期国债收益率在 1.68%关口展开多空拉锯，市场情绪在止盈压力与宽松预期之间反复切换；下旬公积金降息预期叠加跨季资金面呵护，共同推动债市再度走高，其中超长期国债表现尤为抢眼；月底政策落地后，市场止盈情绪升温，利率债出现回调，但 9 月信用债行情持续走强，即使月末仍保持收益率小幅下行的走势。

三季度，转债市场同步跟随权益持续走弱，呈现估值压缩、成交萎缩的特征。行情分化与正股高度绑定，高价、高溢价转债大多对应科技成长标的，正股回调叠加债底支撑偏弱，溢价持续收缩，

回撤压力突出；中低价转债依托债底安全垫，下行幅度相对有限，但缩量环境下流动性压力抬升，放大个券波动。供需端，三季度新券发行节奏小幅提速，市场存量小幅增加，但整体仍维持紧平衡，对优质中低价转债形成一定支撑，但难以对冲权益下行带来的系统性压力，市场交易活跃度明显降温。

报告期内，纯债投资以信用债为主，灵活调整久期和杠杆。转债端淡化指数波动，坚持自下而上精选个券，规避高价高溢价、正股基本面薄弱标的，防范权益下行阶段估值双杀；重点布局低价、溢价合理、正股基本面扎实的品种，依托债底及期权价值控制回撤，同时保留权益企稳后的弹性。组合保持均衡思路，控制整体仓位、做好回撤管理，平衡低估值防御资产与高弹性标的，辅以交易优化，在震荡行情中稳步积累收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末渤海汇金鑫享债券发起 A 基金份额净值为 1.0007 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准收益率为-0.83%；截至报告期末渤海汇金鑫享债券发起 C 基金份额净值为 1.0001 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.21%，同期业绩比较基准收益率为-0.83%。

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	389,570.00	0.61
	其中：股票	389,570.00	0.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,853,763.88	73.67
	其中：债券	46,853,763.88	73.67
	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	13,497,282.47	21.22
	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	2,850,505.28	4.48
8	其他资产	9,831.49	0.02

9	合计	63,600,953.12	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	389,570.00	0.62
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	389,570.00	0.62

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	601108	财通证券	47,800	389,570.00	0.62

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,284,945.21	24.22
	其中：政策性金融债	10,087,643.84	15.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	24,607,770.35	38.99
7	可转债（可交换债）	6,961,048.32	11.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,853,763.88	74.25

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09250412	25 农发清发 12	100,000	10,087,643.84	15.99
2	2120115	21 厦门国际银行永续债 01	50,000	5,197,301.37	8.24
3	102400689	24 华远地产 MTN001	50,000	5,132,042.47	8.13
4	102585254	25 中十七冶 MTN001	50,000	5,130,404.11	8.13
5	102401110	24 爱众发展 MTN001A	50,000	5,127,083.56	8.12

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，厦门国际银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	9,831.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,831.49

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	118065	艾为转债	459,745.27	0.73

2	127104	姚记转债	453,216.13	0.72
3	123252	银邦转债	415,064.59	0.66
4	113042	上银转债	373,564.18	0.59
5	113659	莱克转债	355,671.89	0.56
6	113696	伯 25 转债	340,965.28	0.54
7	111018	华康转债	306,596.09	0.49
8	123165	回天转债	298,855.35	0.47
9	123262	神宇转债	295,890.19	0.47
10	127099	盛航转债	287,335.65	0.46
11	127105	龙星转债	281,089.49	0.45
12	111021	奥锐转债	267,586.23	0.42
13	123253	永贵转债	258,839.40	0.41
14	113678	中贝转债	245,773.86	0.39
15	110090	爱迪转债	222,297.62	0.35
16	113682	益丰转债	208,253.12	0.33
17	113692	保隆转债	206,722.45	0.33
18	113652	伟 22 转债	152,844.64	0.24
19	113643	风语转债	137,632.65	0.22
20	123176	精测转 2	124,800.09	0.20
21	123144	裕兴转债	116,983.17	0.19
22	127064	杭氧转债	98,289.10	0.16
23	118052	浩瀚转债	62,143.69	0.10
24	127072	博实转债	50,421.35	0.08
25	111020	合顺转债	35,201.11	0.06
26	127110	广核转债	8,192.02	0.01

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

	渤海汇金鑫享债券发起 A	渤海汇金鑫享债券发起 C
报告期期初基金份额总额	47,053,513.85	37,880,682.21
报告期期间基金总申购份额	-	18,958.40
减：报告期期间基金总赎回份额	4,231,152.39	17,649,204.38
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	42,822,361.46	20,250,436.23

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	30,001,125.00
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	30,001,125.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	47.57

注：本基金合同于 2026 年 06 月 16 日生效。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.2.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细_本期

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等交易情况。

7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细_上期

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	认购	2026-06-15	30,001,125.00	30,000,000.00	-
合计			30,001,125.00	30,000,000.00	

注：1.表中交易日期为确认日。

2.交易份额包含利息转份额 1,125.00 份。

§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	30,001,125.00	47.57%	30,001,125.00	47.57%	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	-	-	-	-	-
合计	30,001,125.00	47.57%	30,001,125.00	47.57%	-

§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	20260701-20260930	30,001,125.00	-	-	30,001,125.00	47.57%
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

1、本基金管理人于 2026 年 8 月 1 日发布公告，自 2026 年 7 月 31 日起，吴国威先生代任渤海汇金证券资产管理有限公司的财务负责人，原财务负责人边燕萍女士离任。

2、本基金管理人于 2026 年 9 月 17 日发布公告，自 2026 年 9 月 16 日起，不再聘任德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计会计师事务所，改聘容诚会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金的审计会计师事务所。

§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鑫享债券型发起式证券投资基金设立的文件；

2、《渤海汇金鑫享债券型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《渤海汇金鑫享债券型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《渤海汇金鑫享债券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、渤海汇金鑫享债券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

二〇二六年十月二十七日