

# 渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金 2018 年年度报告 摘要

2018 年 12 月 31 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经董事会审议，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期为 2018 年 02 月 11 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	渤海汇金睿选混合	
场内简称	-	
基金主代码	005429	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 11 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	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	21,039,347.63 份	
基金合同存续期	-	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	005429	005430
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	16,679,341.75 份	4,360,005.88 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</p> <p>1、收益率曲线策略： 与权益资产定价不同、固定收益类资产的定价是二维的，即权益资产的价格为一个点，固定资产的价格为一条收益率曲线，根据曲线的形态变化，对应不同的操作策略，如曲线增陡、曲线扁平、蝶式策略、曲线骑乘等。</p> <p>2、组合选择策略： 根据收益率曲线的不同形态，构建不同风险收益特征的组合： 哑铃型组合：配置期限结构两端的债券，利用短期债券保证组合的流动性，利用长期限的债券提高整个组合的收益水平 子弹型组合：集中投资于某一期限附近的债券 阶梯型组合：当收益率曲线的凸起部分是均匀分布时，集中投资于这几个凸起部分所在年期的债券</p> <p>3、杠杆策略：</p>

杠杆的应用可分为以下几种：

息差杠杆：利用回购放大规模，通过久期错配，套取融资利率与标的资产的到期收益率息差

久期杠杆：通过对个券的久期控制，在有限的组合规模下满足不同的目标利率敞口

#### 4、可转债投资策略

本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转债的债底保护，防范信用风险，另一方面，还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。本基金将借鉴信用债的基本面研究，从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、财务稳健性、盈利能力、治理结构等方面进行考察，精选财务稳健、信用违约风险小的可转债进行投资。

#### 5、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

#### 6、股票投资策略

（1）行业配置策略：通过跟踪并量化各行业的景气度、盈利能力、分析师的盈利预期、行业估值等基本面信息，结合行业指数的波动指标、动量变化指标等捕捉最具有投资价值的行业。以此构建行业轮动模型动态调整权益资产中行业配置，提升具有投资价值行业的比例，降低投资价值较低的行业比例，实现相对较优的行业配置，获取行业配置的超额阿尔法收益。

（2）多因子选股策略：通过对股票历史数据的数量化分析，建立影响股票价格的因子库。通过对各类因子打分构建多因子模型，筛选出收益预期较高的股票组合。本基金使用的因子不仅包括公司盈利能力、成长性、一致预期、估值等基本面类因子，同时也包括股票价格波动相关的各类技术指标，例如价格波动率、成交量、动量趋势、超买超卖等。本基金通过对量化模型中各类因子的持续跟踪来监控因子的有效性，根据市场状况结合因子变化趋势，动态选取最优因子构建股票多头组合。

（3）统计套利选股策略：基于均值回归的思想，通过分析历史数据统计投资标的之间存在的稳定性关系。当标的之间的价格波动导致既定关系出现偏离时，这种趋势大概率在未来会得到修正，便会出现套利机会。借助计算机自动捕捉套利机会，挑选历史上大概率跑赢市场的股票组合，以相对较高的成功率进场套利。

（4）事件套利选股策略：通过跟踪分析对投资者行为产生一定影响，可造成市场短期价格波动的事件来获取超额投资收益。此类事件包括但不限于定向增发、股东增持、股权激励、业绩公告、资产注入等，相关事件信息要素均由上市公司公告等公开渠道获得。

#### 7、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，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，选择流动性较高的、交易活跃的期货合约进行空头或多头套

	<p>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>8、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> <p>9、权证投资策略</p> <p>本基金将在严格控制风险、保障基金财产安全的前提下对权证进行投资。本基金将通过权证标的证券基本面研究，采取市场公认的权证定价模型作为权证投资的价值基准，同时充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征进行谨慎投资。此外根据权证衍生工具的特征，通过权证与标的证券组合投资，以期改善组合的风险收益。</p>	
业绩比较基准	上证国债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。	
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		渤海汇金证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周磊	郭明
	联系电话	010-68784298	010-66105799
	电子邮箱	shenkeji@msn.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-651-5988/ 400-651-1717	95588
传真		022-23861651	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.bhhjamc.com">https://www.bhhjamc.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

注：自 2019 年 1 月 10 日，本基金选定的信息披露报纸从上海证券报改为证券日报。

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年2月11日(基金合同生效日)-2018年12月31日		2017年		2016年	
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
本期已实现收益	1,170,565.04	669,562.79	-	-	-	-
本期利润	1,081,512.57	626,796.32	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0240	0.0233	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	1.05%	0.40%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0105	0.0040	-	-	-	-
期末基金资产净值	16,853,896.10	4,377,270.64	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0105	1.0040	-	-	-	-

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同于 2018 年 2 月 11 日生效，截至本报告期末成立未满 1 年，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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

渤海汇金睿选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.53%	0.09%	-2.55%	0.49%	2.02%	-0.40%
过去六个月	-0.70%	0.07%	-2.43%	0.45%	1.73%	-0.38%

自基金合同生效起至今	1.05%	0.07%	-3.24%	0.40%	4.29%	-0.33%
------------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

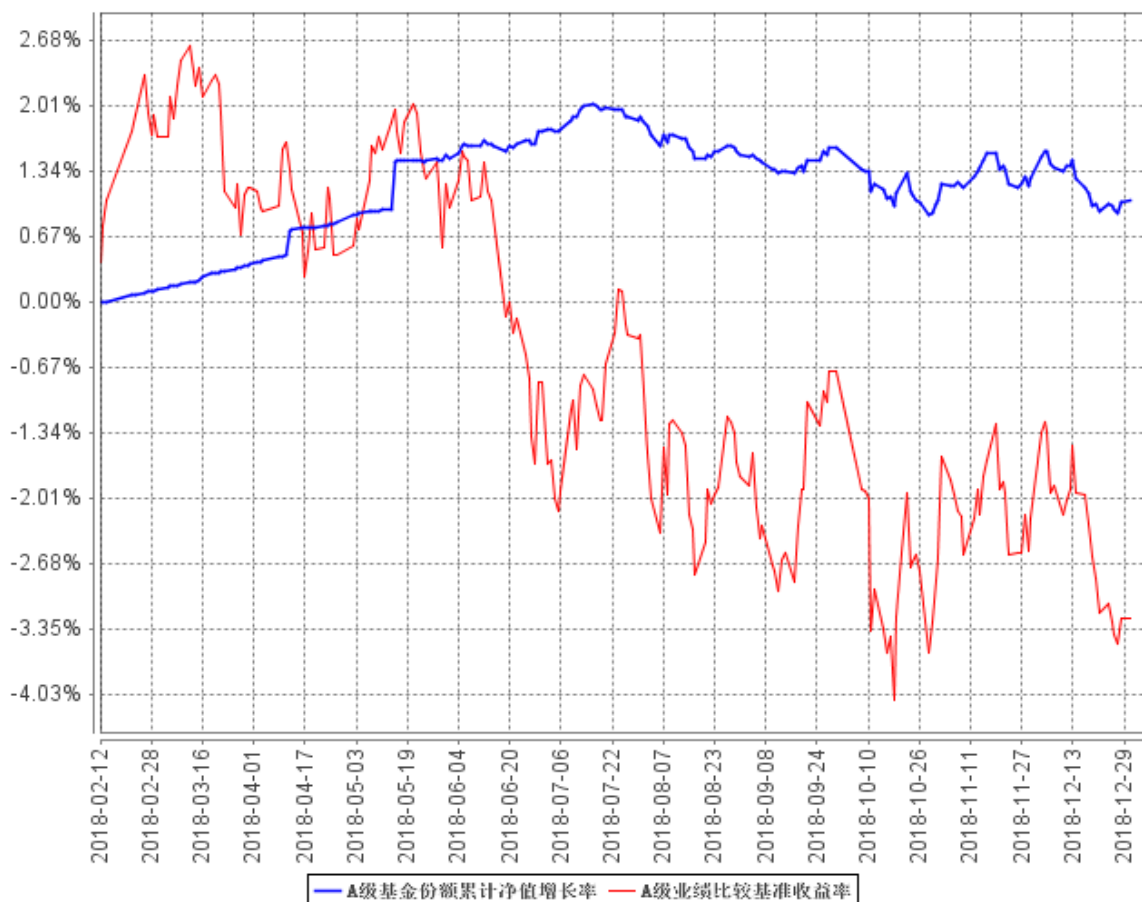
渤海汇金睿选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.68%	0.09%	-2.55%	0.49%	1.87%	-0.40%
过去六个月	-0.99%	0.07%	-2.43%	0.45%	1.44%	-0.38%
自基金合同生效起至今	0.40%	0.06%	-3.24%	0.40%	3.64%	-0.34%

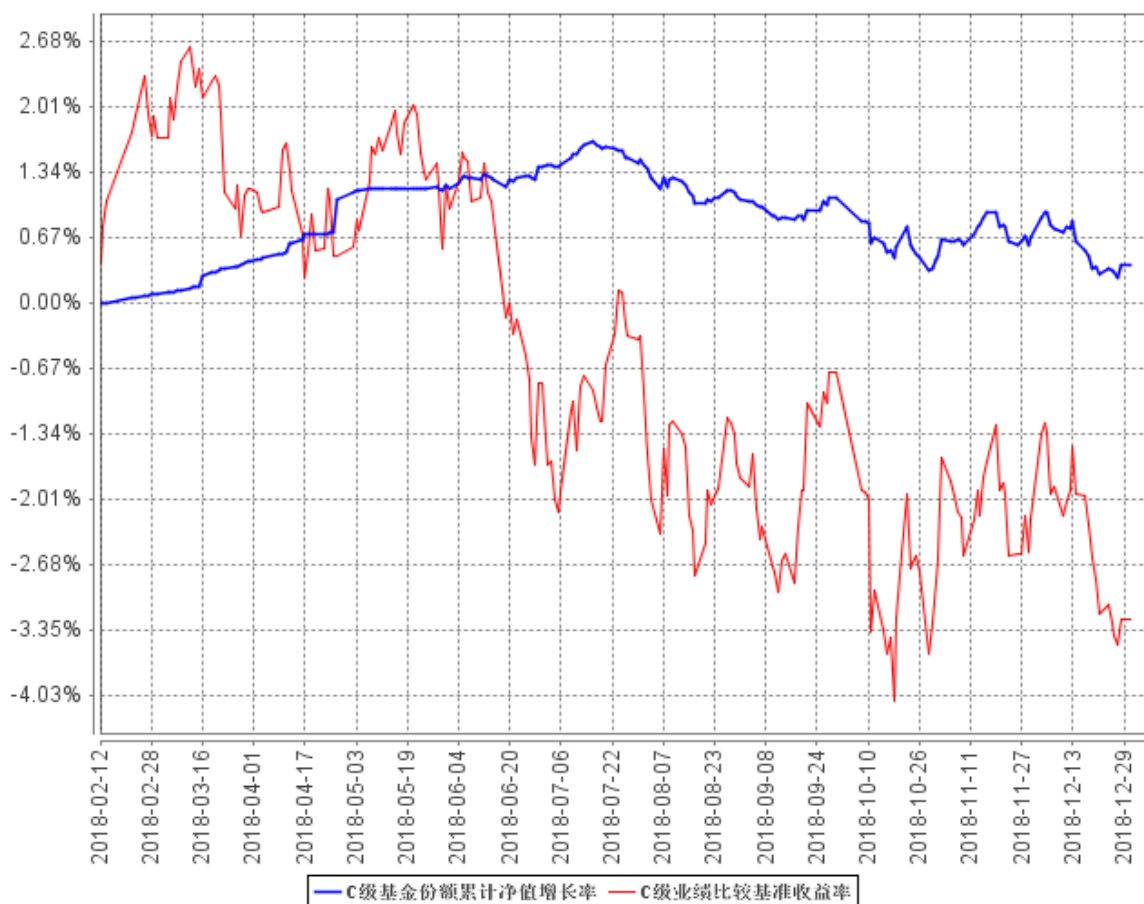
注：业绩比较基准：上证国债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



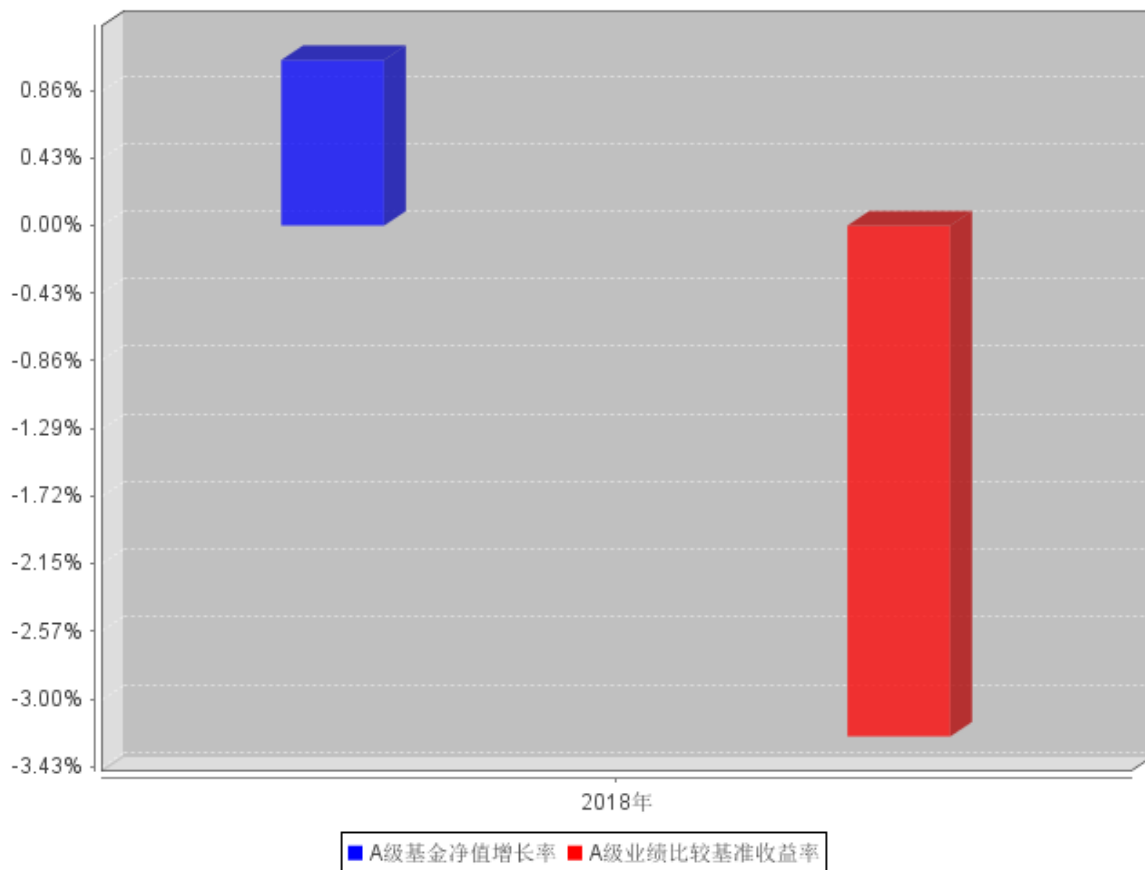
注：1、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 11 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

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。

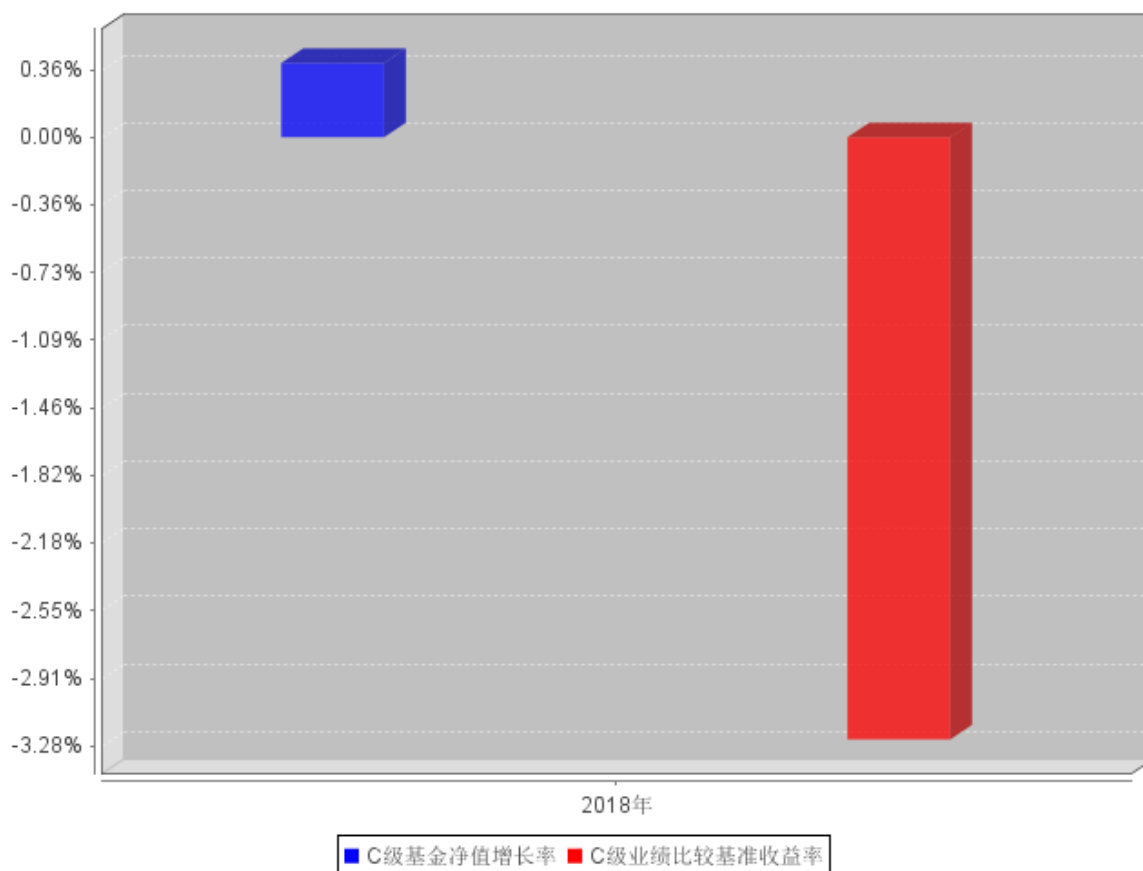
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2018 年 2 月 11 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

渤海汇金睿选混合 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
合计	-	-	-	-	

渤海汇金睿选混合 C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
合计	-	-	-	-	

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

渤海汇金证券资产管理有限公司（简称渤海汇金、渤海汇金资管）前身为渤海证券资产管理总部，经中国证监会证监许可[2016]3 号文批准，成立于 2016 年 5 月 18 日。注册地为深圳，注册资本为 11 亿元，业务范围为证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务，是渤海证券股份有限公司的全资子公司。

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 5 只基金：渤海汇金汇添金货币市场基金、渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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、渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何翔	本基金的基金经理、公募投资总监、公募投资部总经理	2018 年 2 月 11 日	-	14 年	南开大学数学学士、金融学硕士。2004 年 2 月至 2013 年 10 月就职于渤海证券研究所，任金融工程部经理。2013 年 10 月至 2016 年 8 月就职于渤海证券基金管理总部，任投资研究部经理。2016 年 8 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任公募投资总监。2017 年 7 月至 2018 年 12 月 10 日担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2018 年 2 月起担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2018 年 7 月起担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金

					经理。
李杨	本基金的 基金经理	2018 年 2 月 11 日	-	2 年	天津财经大学经济学 学士。2011 年 10 月到 2014 年 4 月，在包商 银行股份有限公司任 债券交易员，2014 年 5 月到 2016 年 8 月，在 天津银行股份有限公司 任债券交易员，2016 年 9 月至今，在渤海汇 金证券资产管理有限 公司任基金经理。2017 年 8 月起任渤海汇金 汇添金货币市场基金 基金经理。2017 年 12 月起任渤海汇金汇增 利 3 个月定期开放债 券型发起式证券投资 基金基金经理。2017 年 12 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。 2018 年 2 月起担任渤 海汇金睿选混合基金 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。

## 4.2 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《渤海汇金睿选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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司《渤海汇金证券资产管理有限公司公募业务公平交易制度》，以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现，结合盘中实时监控，事后分析和信息披露等风险控制措施加强对于公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 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、投资建议和实时投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对投资指令进行综合平衡，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。

### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年债券市场在内外因素的共同作用下，走出了一波牛市行情，长短端债券收益均有大幅的下行。10 年国债和 10 年国开收益率分别下行 70bps 和 120bps，1 年国债和 1 年国开收益分别下行 120bps 和 170bps。推动债券市场走牛的原因包含如下几方面因素：首先，国内经济动能切换期，“几碰头”——即全球贸易摩擦造成外需对国内经济带动作用的减弱；地方投融资和金融机构行为规范带来短期基建增速下行；信用风险暴露，私人部门投资受影响——加剧了经济下行压力。其次，为对冲经济下行风险，疏通信用传导机制，货币政策由稳健中性转向稳健偏宽松，流动性整体保持合理充裕。再次，权益市场表现低迷加之不断爆出的民企债券违约事件，导致市场风险偏好大幅降低，大量资金涌向利率债品种。

报告期内，固定收益类资产主要投资于交易所利率债和交易所回购。交易所利率债配置期限集中在流动性较好的 1-5 年品种，投资组合保持净值稳定增长的同时，无信用敞口，规避信用风险。本基金权益投资方面，持续以稳健运作为前提，严格控制投资风险，在市场整体震荡调整环

境下保持基金净值的稳定，根据量化方法挖掘具有投资价值的股票，较好的控制了基金净值的回撤波动。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末渤海汇金睿选混合 A 基金份额净值为 1.0105 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.05%；截至本报告期末渤海汇金睿选混合 C 基金份额净值为 1.0040 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.40%；同期业绩比较基准收益率为-3.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，从基本面看，经济增长继续承压。目前投资仍是拉动经济的主要动力。2019 年投资将呈现“两上一下”的格局，基建投资托底的必要性上升；制造业投资继续温和增长；受到棚改监管的限制，房地产投资将会下滑。出口受到中美贸易冲突长期化和全球经济下滑压力，将会出现明显下滑，对中国经济增长的贡献继续减小。消费在目前居民部门高杠杆及收入水平有所下滑的情况下也很难起到拉动经济增长的作用。从政策面看，将会采取更为积极的财政政策，货币政策将由稳健中性转为稳健宽松，维持流动性“合理充裕”。美联储加息路径的放缓也为我国货币政策的独立性留出更大空间，在基本面企稳前，难言转向。从市场情绪看，2019 年宽信用的政策还会逐步发力，效果将会逐渐显现，市场风险偏好将有所修复。

货币政策持续宽松和经济基本面下行压力这两方面因素是推动 2018 年债券市场牛市的主要因素。展望 2019 年我们认为上述因素仍然对债券市场形成支撑。另外，全球经济增速的下行以及联储加息步伐的放慢也给予我们货币政策更大的空间。所以 2019 年债券市场在低利率的环境下仍然存在一定的配置和交易机会。另一方面，经历 2018 年的债券牛市之后，债券的票息保护厚度显著降低，趋势性机会的幅度较 2018 年将大幅减少。此外，若我国稳增长政策显著发力并且伴随信用传导机制疏通，可能会对市场预期产生一定影响，造成利率特别是交易盘活跃的 10 年期利率品种的大幅波动。预计 2019 年股票市场会在风险偏好修复的波动下震荡筑底，股票资产长期配置价值愈加凸显，市场结构性机会亦会逐步涌现，科技成长类等新经济相关板块会迎来更多投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管

理的合规性管理。明确合规标准且风险可控的前提下，积极响应业务需求，为业务发展提供合规支持。既保证业务顺利展开，又防范了重大合规风险。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务，在投资范围、投资工具、运作规则等方面，重点关注防控风险。同时，加强反洗钱、反恐怖融资和反逃税工作。

为进一步规范公司合规管理工作，将合规管理渗透到公司各部门，建立公司依法经营、合规运作的长效机制，公司修订了《渤海汇金证券资产管理有限公司法律合规部管理办法》、《渤海汇金证券资产管理有限公司合规检查管理规定》、《渤海汇金证券资产管理有限公司合规管理人员职责管理细则》等制度。建立各项业务间风险、合规信息的沟通与共享机制，充分发挥风控合规工作统筹协调的作用，实现在关键业务开展、新规则实施前及突发业务发生时，合规风控明确标准，相关业务部门共同参与讨论，建立更新流程，做到关键业务的风险可控。

同时，完成日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，消除新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险隐患。

此外，我们还积极配合监管机关进行各类统计调查工作，按时完成季度、年度监察稽核报告及附表。

公司监察稽核工作整体平稳开展，根据监管变化和基金业务开展情况，适时调整工作安排，提高监察稽核工作质量，明确监察稽核各业务环节工作职责，规范稽核工作程序，加强对公司各业务条线、各部门的管理和监督，防范和控制风险，改善公司的经营管理情况。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由投资负责人、研究负责人、产品设计负责人、财务负责人、运营保障负责人、风险控制部和法律合规部负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。公募投资部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金合同（第十六部分基金的收益与分配中三、基金收益分配原则）的约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

无。

#### **4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，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 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内，渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金的管理人渤海汇金证券资产管理有限公司在渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。



## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对渤海汇金证券资产管理有限公司编制和披露的渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 26124 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金(以下简称“渤海汇金睿选混合”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了渤海汇金睿选混合 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适

	<p>当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于渤海汇金睿选混合，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>渤海汇金睿选混合的基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估渤海汇金睿选混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算渤海汇金睿选混合、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督渤海汇金睿选混合的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设</p>

	<p>计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对渤海汇金睿选混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致渤海汇金睿选混合不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	李铁英   朱辉
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 22 日

注：会计师出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	66,021.53	-
结算备付金		233,904.90	-
存出保证金		1,175.36	-
交易性金融资产	7.4.7.2	13,314,526.30	-
其中：股票投资		1,305,512.30	-
基金投资		-	-
债券投资		12,009,014.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	7,500,000.00	-
应收证券清算款		202,179.11	-
应收利息	7.4.7.5	261,527.95	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		21,579,335.15	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		149,284.65	-
应付管理人报酬		22,170.19	-
应付托管费		3,695.04	-
应付销售服务费		2,305.97	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,149.93	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	169,562.63	-
负债合计		348,168.41	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	21,039,347.63	-
未分配利润	7.4.7.10	191,819.11	-
所有者权益合计		21,231,166.74	-
负债和所有者权益总计		21,579,335.15	-

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，渤海汇金睿选混合 A 基金份额净值 1.0105 元，基金份额总额 16679341.75 份；渤海汇金睿选混合 C 基金份额净值 1.0040 元，基金份额总额 4360005.88 份。渤海汇金睿选混合份额总额合计为 21039347.63 份。

## 7.2 利润表

会计主体：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 2 月 11 日(基金 合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		3,003,558.35	-
1.利息收入		3,252,552.60	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,230,834.85	-
债券利息收入		1,158,617.18	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		863,100.57	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-766,641.77	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-168,643.46	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-603,118.00	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	5,119.69	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-131,818.94	-

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	649,466.46	-
<b>减：二、费用</b>		1,295,249.46	-
1. 管理人报酬	7.4.9.2.1	801,952.69	-
2. 托管费	7.4.9.2.2	133,658.74	-
3. 销售服务费	7.4.9.2.3	151,304.99	-
4. 交易费用	7.4.7.19	10,569.28	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,314.79	-
7. 其他费用	7.4.7.20	195,448.97	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,708,308.89	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,708,308.89	-

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	285,984,563.38	-	285,984,563.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,708,308.89	1,708,308.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-264,945,215.75	-1,516,489.78	-266,461,705.53
其中：1. 基金申购款	13,997.85	210.16	14,208.01
2. 基金赎回款	-264,959,213.60	-1,516,699.94	-266,475,913.54
四、本期向基金份额持有	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	21,039,347.63	191,819.11	21,231,166.74
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

          徐海军  周里勇  徐长莹            
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]第1193号《关于准予渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认

购资金利息共募集人民币 285,960,172.45 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2018)第 0120 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 285,984,563.38 份基金份额,其中认购资金利息折合 24,390.93 份基金份额。本基金的基金管理人为渤海汇金证券资产管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单等货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不超过 40%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金业绩比较基准:上证国债指数收益率 $\times$ 70%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 30%。

本财务报表由本基金的基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司于 2019 年 3 月 22 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。



### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括应付管理人报酬和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益; 对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 单独确认为应收项目。应

收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

##### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

(a) 存在活跃市场的金融工具，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值；且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价(收盘价)估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(b) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日第三

方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(c)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(d)交易所上市的资产支持证券等不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(a)送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价(收盘价)估值；

(b)首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(c)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3)全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

(4)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 本基金投资期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(6) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

(7) 本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生

收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税，对存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

(2) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	66,021.53	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	66,021.53	-

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,511,023.84	1,305,512.30	-205,511.54	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	11,935,321.40	12,009,014.00	73,692.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	11,935,321.40	12,009,014.00	73,692.60
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	13,446,345.24	13,314,526.30	-131,818.94	
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	-	-	-	



## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日			
	合同/名义金 额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	
项目	上年度末 2017年12月31日			
	合同/名义金 额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,500,000.00	-
项目	上年度末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定 返售日	估值单价	数量（张）	估值 总额	其中：已出售 或再质押总额

合计						-	-	-
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日							
	债券代码	债券名称	约定 返售日	估值单价	数量 (张)	估值 总额	其中: 已出售 或再质押总额	
合计						-	-	-

注: 本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	19.47	-
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	91.08	-
应收债券利息	255,894.37	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	5,522.37	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	0.66	-
合计	261,527.95	-

#### 7.4.7.6 其他资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-

注: 本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位: 人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,149.93	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,149.93	-

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	562.63	-
预提费用	169,000.00	-
合计	169,562.63	-

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

渤海汇金睿选混合 A		
项目	本期 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	140,755,966.61	140,755,966.61
本期申购	9,814.79	9,814.79
本期赎回 (以“-”号填列)	-124,086,439.65	-124,086,439.65
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	16,679,341.75	16,679,341.75

渤海汇金睿选混合 C		
项目	本期 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	145,228,596.77	145,228,596.77
本期申购	4,183.06	4,183.06
本期赎回 (以“-”号填列)	-140,872,773.95	-140,872,773.95
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	4,360,005.88	4,360,005.88

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

(2) 本基金于 2018 年 1 月 9 日至 2018 年 2 月 7 日止向社会公开募集，截至 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)止，募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 285,960,172.45 元，在募集

期间产生的活期存款利息为人民币 24,390.93 元，以上实收基金合计 285,984,563.38 元折合为 285,984,563.38 份渤海汇金睿选混合份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

渤海汇金睿选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,170,565.04	-89,052.47	1,081,512.57
本期基金份额交易产生的变动数	-907,950.98	992.76	-906,958.22
其中：基金申购款	170.16	3.06	173.22
基金赎回款	-908,121.14	989.70	-907,131.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	262,614.06	-88,059.71	174,554.35

渤海汇金睿选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	669,562.79	-42,766.47	626,796.32
本期基金份额交易产生的变动数	-629,404.50	19,872.94	-609,531.56
其中：基金申购款	46.96	-10.02	36.94
基金赎回款	-629,451.46	19,882.96	-609,568.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,158.29	-22,893.53	17,264.76

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	38,606.19	-
定期存款利息收入	1,185,631.95	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,575.40	-
其他	21.31	-
合计	1,230,834.85	-

#### 7.4.7.12 股票投资收益

**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出股票成交总额	839,521.60	-
减：卖出股票成本总额	1,008,165.06	-
买卖股票差价收入	-168,643.46	-

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	-603,118.00	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-603,118.00	-

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	136,040,936.74	-
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	133,328,199.00	-
减：应收利息总额	3,315,855.74	-
买卖债券差价收入	-603,118.00	-

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合 同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
赎回基金份额对价总额	-	-
减: 现金支付赎回款总额	-	-
减: 赎回债券成本总额	-	-
减: 赎回债券应收利息总额	-	-
赎回差价收入	-	-

注: 无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合 同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
申购基金份额对价总额	-	-
减: 现金支付申购款总额	-	-
减: 申购债券成本总额	-	-
减: 申购债券应收利息总额	-	-
申购差价收入	-	-

注: 无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合 同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
卖出资产支持证券成交总 额	-	-
减: 卖出资产支持证券成本 总额	-	-
减: 应收利息总额	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

注: 本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注: 本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

#### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出权证成交总额	-	-
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	-	-

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间收益金额 2017年1月1日至2017年12月31日
股指期货-投资收益	-	-

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,119.69	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,119.69	-

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-131,818.94	-
——股票投资	-205,511.54	-
——债券投资	73,692.60	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-131,818.94	-

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	649,466.46	-
合计	649,466.46	-

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	7,809.28	-
银行间市场交易费用	2,760.00	-
合计	10,569.28	-

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	-
信息披露费	80,000.00	-



其他费用	400.00	-
银行汇划费用	7,848.97	
银行间账户维护费	27,200.00	
合计	195,448.97	-

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
渤海汇金证券资产管理有限公司（“渤海汇金资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
渤海证券股份有限公司（“渤海证券”）	基金管理人的独资股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至 2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
渤海证券	3,343,050.50	100.00%	-	-

##### 7.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至 2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例

渤海证券	31,944,531.20	100.00%	-	-
------	---------------	---------	---	---

#### 7.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至 2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
渤海证券	983,501,000.00	100.00%	-	-

#### 7.4.9.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至 2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
渤海证券	6,603.52	100.00%	1,149.93	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

#### 7.4.9.2 关联方报酬

**7.4.9.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	801,952.69	-
其中：支付销售机构的客户维护费	140,174.31	-

注：支付基金管理人渤海汇金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.2% / 当年天数。

**7.4.9.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	133,658.74	-

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

**7.4.9.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C	合计
渤海汇金资管	-	151,304.99	151,304.99
合计	-	151,304.99	151,304.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C	合计

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月

月底，按月支付给渤海汇金，再由渤海汇金计算并支付给各基金销售机构。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.60 / 当年天数。

#### 7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 11 日）持有的基金份额	10,000,444.49	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,444.49	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	59.9600%	-

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 11 日）持有的基金份额	-	-

期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：本基金的申购费率适用于所有基金投资人，赎回费率适用于所有基金份额持有人。

#### 7.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

渤海汇金睿选混合 A				
关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

份额单位：份

渤海汇金睿选混合 C				
关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

注：本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金 A 类及 C 类基金份额的情况。

#### 7.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	66,021.53	38,606.19	-	-

注：本基金的活期银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位：份)	总金额
上年度可比期间					

2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 份)	总金额

注: 本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.10 期末 (2018 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.10.1.2 受限证券类别: 债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.10.1.3 受限证券类别: 权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

注: 本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018 年 12 月 24 日	重大资产重组	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	1,800	30,744.00	28,818.00	-

注: 本集合计划截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大资产重组可能产生重大影响而被暂时停牌的股票, 该类股票将在所公布事项的重大影响消除后, 经交易所批准复牌。

##### 7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量 (张)	期末估值总额
------	------	-------	--------	--------	--------

合计				-	-
----	--	--	--	---	---

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 13,285,708.30 元，第二层次的余额为人民币 28,818.00 元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,305,512.30	6.05
	其中：股票	1,305,512.30	6.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,009,014.00	55.65
	其中：债券	12,009,014.00	55.65
	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	7,500,000.00	34.76
	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	299,926.43	1.39
8	其他各项资产	464,882.42	2.15
9	合计	21,579,335.15	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	13,225.00	0.06
B	采矿业	8,585.00	0.04
C	制造业	716,249.30	3.37



D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,846.00	0.10
E	建筑业	25,453.00	0.12
F	批发和零售业	19,776.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	20,361.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	167,443.00	0.79
J	金融业	207,416.00	0.98
K	房地产业	37,929.00	0.18
L	租赁和商务服务业	9,086.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	1,965.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	9,322.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,329.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	26,527.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	1,305,512.30	6.15

### 8.2.2 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。

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	100	59,001.00	0.28
2	601688	华泰证券	2,500	40,500.00	0.19
3	601318	中国平安	600	33,660.00	0.16
4	300059	东方财富	2,700	32,670.00	0.15

5	600030	中信证券	1,800	28,818.00	0.14
6	000858	五粮液	500	25,440.00	0.12
7	603986	兆易创新	400	24,928.00	0.12
8	603650	彤程新材	1,000	19,830.00	0.09
9	300408	三环集团	1,100	18,612.00	0.09
10	300226	上海钢联	400	18,212.00	0.09

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	361,372.00	1.70
2	000661	长春高新	113,349.00	0.53
3	603986	兆易创新	66,979.00	0.32
4	600436	片仔癀	55,350.00	0.26
5	300122	智飞生物	48,029.00	0.23
6	000858	五粮液	46,574.90	0.22
7	601318	中国平安	44,184.00	0.21
8	603883	老百姓	43,644.00	0.21
9	601688	华泰证券	43,150.00	0.20
10	300015	爱尔眼科	41,785.00	0.20
11	300003	乐普医疗	39,127.00	0.18
12	300059	东方财富	38,349.00	0.18
13	600276	恒瑞医药	36,498.00	0.17
14	300347	泰格医药	33,624.00	0.16
15	600486	扬农化工	33,226.00	0.16
16	300226	上海钢联	32,567.00	0.15
17	600030	中信证券	30,744.00	0.14
18	002371	北方华创	30,045.00	0.14
19	300408	三环集团	28,119.00	0.13
20	000963	华东医药	28,064.00	0.13

注：本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易

费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	240,790.00	1.13
2	000661	长春高新	77,115.00	0.36
3	600436	片仔癀	37,587.00	0.18
4	300122	智飞生物	30,681.00	0.14
5	300347	泰格医药	28,548.00	0.13
6	300015	爱尔眼科	24,810.00	0.12
7	603883	老百姓	23,471.00	0.11
8	300003	乐普医疗	20,155.00	0.09
9	000963	华东医药	20,027.00	0.09
10	603986	兆易创新	19,312.00	0.09
11	600486	扬农化工	19,140.00	0.09
12	600276	恒瑞医药	17,854.00	0.08
13	600771	广誉远	17,377.00	0.08
14	000858	五粮液	12,781.00	0.06
15	300226	上海钢联	10,373.00	0.05
16	002371	北方华创	10,096.00	0.05
17	603019	中科曙光	9,770.00	0.05
18	000418	小天鹅 A	9,637.00	0.05
19	002044	美年健康	9,137.60	0.04
20	000333	美的集团	8,439.00	0.04

注：本项的“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,519,188.90
卖出股票收入（成交）总额	839,521.60

注：本项的“买入股票成本(成交)总额”及“卖出股票收入(成交)总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	6,077,000.00	28.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,932,014.00	27.94
	其中：政策性金融债	5,932,014.00	27.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,009,014.00	56.56

## 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	018006	国开 1702	21,640	2,209,444.00	10.41
2	010107	21 国债(7)	20,000	2,059,000.00	9.70
3	010303	03 国债(3)	20,000	2,016,400.00	9.50
4	019585	18 国债 03	20,000	2,001,600.00	9.43
5	018005	国开 1701	18,000	1,807,920.00	8.52

## 8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	------	---------------

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，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，选择流动性较高的、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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.12.1 本期国债期货投资政策**

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,以套期保值为目的,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

**8.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 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**

无。

**8.12.2 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。**

无。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,175.36
2	应收证券清算款	202,179.11
3	应收股利	-
4	应收利息	261,527.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	464,882.42

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	28,818.00	0.14	资产重组停牌

**8.12.6 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。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
渤海汇金睿选混合 A	151	110,459.22	10,000,444.49	59.96%	6,678,897.26	40.04%
渤海汇金睿选混合 C	78	55,897.51	0.00	0.00%	4,360,005.88	100.00%
合计	226	93,094.46	10,000,444.49	47.53%	11,038,903.14	52.47%

注：期末有三名基金份额持有人同时持有渤海汇金睿选混合 A 份额和渤海汇金睿选混合 C 份额。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	渤海汇金睿选混合 A	215,898.64	1.0262%
	渤海汇金睿选混合 C	0.00	-
	合计	215,898.64	1.0262%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	渤海汇金睿选混合 A	10~50
	渤海汇金睿选混合 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	渤海汇金睿选混合 A	0~10
	渤海汇金睿选混合 C	-
	合计	0~10

## 9.4 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	发起份额总数	发起份额占基金总份额	发起份额承诺持有期限



		比例 (%)		比例 (%)	
基金管理人固有资金	10,000,444.49	47.53	10,000,444.49	47.53	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	59,961.40	0.28	-	-	-
基金经理等人员	49,950.05	0.24	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,110,355.94	48.05	10,000,444.49	47.53	自合同生效之日起不少于三年

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
基金合同生效日（2018年2月11日）基金份额总额	140,755,966.61	145,228,596.77
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,814.79	4,183.06
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	124,086,439.65	140,872,773.95
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）	-	-
本报告期末基金份额总额	16,679,341.75	4,360,005.88

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于 2018 年 7 月 25 日发布公告，自 2018 年 7 月 23 日起，渤海汇金证券资产管理有限公司的董事会秘书由李唤工先生变更为周里勇先生。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，管理人与前员工发生劳动争议民事诉讼，对基金份额持有人利益无任何不利影响。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为其审计机构。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 80,000.00 元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为基金成立日(2018 年 2 月 11 日)起至本报告期末，不满一年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人、托管人及高级管理人员受到稽查或者处罚情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	2	3,343,050.50	100.00%	6,603.52	100.00%	-

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
渤海证券	31,944,531.20	100.00%	983,501,000.00	100.00%	-	-

注：1、本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计。

## 2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准：券商经营行为规范；具有较强的研究服务能力，包括研究及投资建议质量、报告的及时性和服务质量；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格；本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

4、本基金本报告期内无新增券商交易单元。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20180316-20180411	50,001,222.22	0.00	50,001,222.22	0.00	0.00%
	2	20180412-20180514	29,999,000.00	0.00	29,999,000.00	0.00	0.00%
	3	20180427-20180514	19,999,000.00	0.00	19,999,000.00	0.00	0.00%
	4	20180515-20181231	10,000,444.49	0.00	0.00	10,000,444.49	47.53%
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>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

渤海汇金证券资产管理有限公司  
2019 年 3 月 28 日