

渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资  
基金  
2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 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。本半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 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	渤海汇金量化汇盈混合
场内简称	-
基金主代码	005021
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 7 月 20 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	15,582,970.02 份
基金合同存续期	-
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过构建数量化投资策略，在严格控制风险的基础上，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，实现基金资产的持续稳健增长。
投资策略	<p>本基金运用现代金融学、数学、统计学等科学方法，借助计算机的信息处理能力，在大类资产配置、行业配置和个股配置三个层面构建数量化投资策略，捕捉各种市场特征下的投资机会，同时辅以量化模型控制基金整体的波动和风险，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。</p> <p>1、大类资产配置策略： 采用风险平价模型等量化分析的方法构建大类资产配置模型，动态配置股票与债券资产的投资比例，平衡分配不同资产类别的风险贡献度，避免投资组合暴露在单一资产类别的风险敞口中，从而动态控制基金资产的整体风险。同时结合国内外宏观经济走势、财政货币政策、行业发展趋势等因素，辅以定性分析来增强大类资产配置的功效。</p> <p>2、行业配置策略： 通过跟踪各行业的景气度、盈利能力、分析师的盈利预期、行业估值等基本面因子，结合行业指数的波动指标、动量变化指标等市场因子，构建行业轮动模型，捕捉最具有投资价值的行业，并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。</p>

### 3、量化股票投资策略：

(1) 多因子选股策略：通过对股票历史数据的数量化分析，充分挖掘影响股票价格的因子，通过检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度，对各类因子打分挑选出有效的因子组合，并结合风险和收益特征构建多因子模型，筛选出收益预期较高且风险可控的股票组合。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，并根据市场变化趋势，对模型进行调整，以改进模型的有效性。

(2) 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，以相对较高的成功概率进场套利。

(3) 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。

### 4、债券投资策略：

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。

首先，通过对国内外宏观经济形势、财政政策、货币政策以及债券市场供求关系等因素的分析，结合基金资产的流动性需求，确定债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排。

其次，在上述约束条件下，综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

此外，本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究，通过对转债品种的转股溢价率、纯债溢价率、到期收益率等指标分析，寻找具有债性支撑并且兼具一定股性的品种，捕捉其投资机会。

### 5、股指期货和国债期货投资策略：

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

	<p>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>基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。</p> <p>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>6、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>7、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	60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率
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。

### 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	徐海军	郭明
	联系电话	022-28451906	010-66105799
	电子邮箱	xuhaijun@bhjq.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-651-5988/	95588

	400-651-1717	
传真	022-23861651	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	2,437,248.69
本期利润	4,030,668.55
加权平均基金份额本期利润	0.1298
本期基金份额净值增长率	9.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0816
期末基金资产净值	16,854,171.33
期末基金份额净值	1.0816

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7月20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

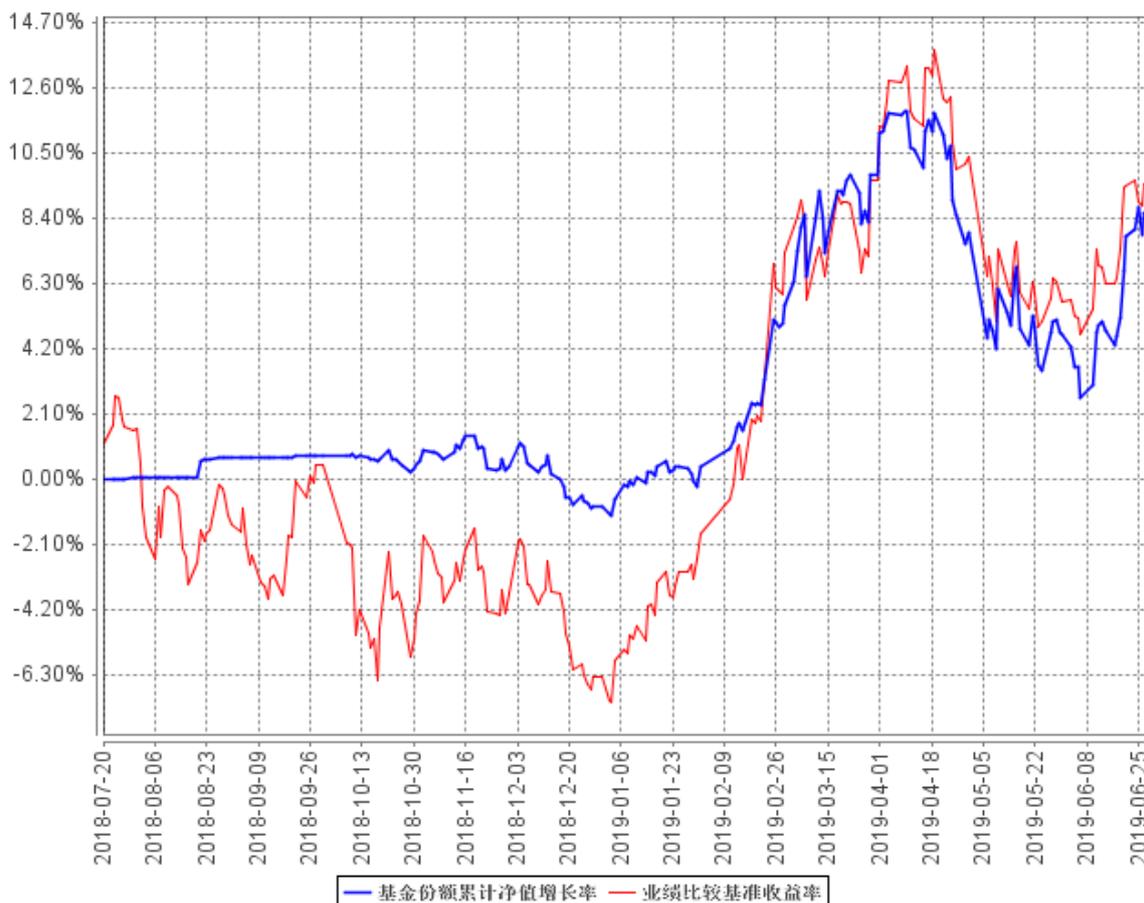
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	3.36%	0.70%	3.42%	0.70%	-0.06%	0.00%
过去三个月	-1.48%	0.85%	-0.26%	0.92%	-1.22%	-0.07%
过去六个月	9.14%	0.75%	16.79%	0.93%	-7.65%	-0.18%
自基金合同生效起至今	8.16%	0.55%	9.33%	0.92%	-1.17%	-0.37%

注：业绩比较基准：上证国债指数收益率×40%+沪深300指数收益率×60%。

### 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

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 7 月 20 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。

## § 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2019年6月30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7月20日	-	15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。
林思	本基金的基金经理	2018年7月20日	-	7年	南开大学金融工程硕士。2011年7月至2013年10月就职于渤海证券研究所，任金融工程分析师。

					2013 年 10 月至 2016 年 8 月就职于渤海证券基金管理总部，任基金经理助理。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，任基金经理。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 7 月起担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型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。

### 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 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

2019 年上半年 A 股市场经历了一季度的外资加快流入，监管预期进一步放松、股票市场战略地位提升、风险偏好上升等多重利好下，A 股市场迎来全面反弹；进入二季度之后，市场回调震荡，主要源于一季度估值修复完毕后，在贸易摩擦、流动性、基本面反复和不确定下对市场乐观预期的一个理性下修。

报告期内，本基金以严格风险控制为前提，通过对宏观环境的研判和量化策略分析，稳健配置大类资产，控制基金净值波动与回撤，去年年底到今年年初我们的量化估值体系显示股票资产已经逐步具备相对估值优势和长期配置价值，基金在稳健运作的前提下通过量化选股策略逐步提高股票资产的配置比例以增强基金资产的持续收益能力，并在市场震荡调整期积极调整资产配置，以提高基金资产的稳健性和整体抗风险能力。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0816 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.14%，业绩比较基准收益率为 16.79%。

## 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 年下半年，地产投资、出口、制造业投资压力比较大，消费和基建投资成为稳经济的重要支撑点。实际 GDP 调整的幅度取决于政策的力度，整体经济并无失速风险。考虑到正面的减税降费提振、流动性环境预期宽松和负面的中美贸易、外需减弱及政策时滞等方面综合影响，宏观经济增长和微观经济与企业盈利在 2019 年下半年仍面临下行压力，政策托底稳增长可能是决定市场节奏的重要变量之一。逆周期调节的工具如消费刺激政策、减税、降准以及降息等政策手段均有一定的实施空间。

我们预计 2019 年下半年 A 股市场会在震荡中逐步寻求反弹的机会，一些事件都在向好的方向发展，如贸易谈判重启、全球降息升温、国内流动性相对宽松。市场继续大幅下探的可能性不大，但在贸易摩擦与企业盈利两大制约条件没有解除的情况下，市场向上的空间亦不会立刻打开。本基金亦会在震荡市场环境中继续保持相对均衡的资产配置，通过量化选股积极把握市场的结构性机会。

## 4.6 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。

#### **4.7 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。

#### **4.8 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**

报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况。本基金自 2019 年 2 月 19 日至 2019 年 6 月 30 日连续 89 个工作日基金资产净值低于五千万元，管理人已将该情况向证监会报告，鉴于本基金的运作情况，基金管理人的解决方案为：将不断完善已有持营方案，加大对本基金的持续营销。

## § 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量化汇盈灵活配置混合型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，渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型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量化汇盈灵活配置混合型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 托管人对本半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量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	85,785.27	239,748.62
结算备付金	773,997.55	1,568,760.18
存出保证金	187,698.04	777,671.00
交易性金融资产	14,970,612.84	39,653,442.30
其中：股票投资	9,654,943.34	8,715,491.00
基金投资	-	-
债券投资	5,315,669.50	30,937,951.30
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	800,000.00	17,400,000.00
应收证券清算款	100,184.11	6,499.48
应收利息	65,041.69	617,965.26
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	16,983,319.50	60,264,086.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	1,064.88	53,651.70
应付管理人报酬	21,122.51	77,715.19
应付托管费	3,520.40	12,952.53
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	30,455.65	16,842.16
应交税费	70.17	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	72,914.56	135,134.79
负债合计	129,148.17	296,296.37
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	15,582,970.02	60,511,453.66
未分配利润	1,271,201.31	-543,663.19
所有者权益合计	16,854,171.33	59,967,790.47
负债和所有者权益总计	16,983,319.50	60,264,086.84

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0816 元，基金份额总额 15,582,970.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	4,504,468.02	-
1.利息收入	359,067.72	-
其中：存款利息收入	4,474.29	-
债券利息收入	259,392.66	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	95,200.77	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,519,442.64	-
其中：股票投资收益	1,549,049.37	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	33,200.50	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	873,116.51	-
股利收益	64,076.26	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,593,419.86	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	32,537.80	-
<b>减：二、费用</b>	473,799.47	-
1. 管理人报酬	245,490.79	-
2. 托管费	40,915.08	-
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	99,633.77	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	3,143.23	-
7. 其他费用	84,616.60	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4,030,668.55	-
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4,030,668.55	-

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	60,511,453.66	-543,663.19	59,967,790.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,030,668.55	4,030,668.55
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）	-44,928,483.64	-2,215,804.05	-47,144,287.69
其中：1.基金申购款	352,874.09	21,955.58	374,829.67
2.基金赎回款	-45,281,357.73	-2,237,759.63	-47,519,117.36
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）	15,582,970.02	1,271,201.31	16,854,171.33
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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)	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金(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[2018]第 371 号《关于准予渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》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《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型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 234,005,295.59 元,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 0493 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金合同》于 2018 年 7 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 234,129,606.83 份基金份额,其中认购资金利息折合 124,311.24 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《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，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(包含主板、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、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具(含同业存单)、资产支持证券、债券回购、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 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金(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的比例合计不低于基金资产净值的 5%；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准： $60\% \times$  沪深 300 指数收益率 $+40\% \times$  上证国债指数收益率。

#### 6.4.2 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》、《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 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。

### 6.4.5.2 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。

### 6.4.5.3 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。

## 6.4.6 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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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：1、本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.8.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	49,759,325.00	100.00%	-	-

**6.4.8.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	10,956,650.40	100.00%	-	-

**6.4.8.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	209,100,000.00	100.00%	-	-
------	----------------	---------	---	---

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	245,490.79	-
其中：支付销售机构的客户维护费	159,566.68	-

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 1.5%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×1.5%/当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	40,915.08	-

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 0.25%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×0.25%/当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无销售服务费。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2018 年 7 月 20 日）持有的基金份额	339,592.49	-
报告期初持有的基金份额	339,592.49	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	339,592.49	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.18%	-

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。

##### 6.4.8.4.2 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

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的情况。

#### 6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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	85,785.27	2,089.18	-	-

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。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 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。

#### 6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

#### **6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

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。

##### **6.4.9.3.2 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。

#### **6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	9,654,943.34	56.85
	其中：股票	9,654,943.34	56.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,315,669.50	31.30
	其中：债券	5,315,669.50	31.30
	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	800,000.00	4.71
	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	859,782.82	5.06
8	其他各项资产	352,923.84	2.08
9	合计	16,983,319.50	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	139,923.00	0.83
B	采矿业	1,894,019.00	11.24
C	制造业	4,683,511.84	27.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	148,526.00	0.88
E	建筑业	122,195.00	0.73
F	批发和零售业	385,231.00	2.29
G	交通运输、仓储和邮政业	155,218.80	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	943,034.20	5.60
J	金融业	328,581.20	1.95
K	房地产业	211,540.00	1.26
L	租赁和商务服务业	37,800.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	72,854.00	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	122,394.00	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	162,195.30	0.96
R	文化、体育和娱乐业	193,988.00	1.15
S	综合	53,932.00	0.32
	合计	9,654,943.34	57.29

## 7.2.2 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。

## 7.3 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	002237	恒邦股份	19,100	319,161.00	1.89
2	600547	山东黄金	6,700	275,839.00	1.64
3	600489	中金黄金	26,300	270,101.00	1.60
4	601899	紫金矿业	67,000	252,590.00	1.50
5	601069	西部黄金	15,700	241,780.00	1.43
6	000975	银泰资源	18,200	240,058.00	1.42
7	300059	东方财富	10,760	145,798.00	0.87
8	002155	湖南黄金	13,200	132,924.00	0.79
9	600766	园城黄金	12,800	130,688.00	0.78
10	600311	荣华实业	26,100	125,019.00	0.74

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半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	002626	金达威	249,913.00	0.42
2	300624	万兴科技	244,006.00	0.41
3	603599	广信股份	240,779.00	0.40
4	603258	电魂网络	237,337.00	0.40
5	002901	大博医疗	235,935.00	0.39
6	002577	雷柏科技	232,959.00	0.39
7	002267	陕天然气	230,092.00	0.38
8	600489	中金黄金	223,811.00	0.37

9	601899	紫金矿业	223,442.00	0.37
10	002237	恒邦股份	223,366.00	0.37
11	600547	山东黄金	222,175.00	0.37
12	601069	西部黄金	221,923.00	0.37
13	000975	银泰资源	221,180.00	0.37
14	000034	神州数码	208,672.00	0.35
15	601595	上海电影	201,720.00	0.34
16	600602	云赛智联	187,766.00	0.31
17	002458	益生股份	183,882.00	0.31
18	002279	久其软件	182,863.00	0.30
19	603039	泛微网络	181,940.44	0.30
20	601929	吉视传媒	178,080.00	0.30

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	603258	电魂网络	425,627.00	0.71
2	601929	吉视传媒	336,557.00	0.56
3	000791	甘肃电投	329,696.00	0.55
4	000601	韶能股份	318,388.00	0.53
5	002626	金达威	309,889.00	0.52
6	002322	理工环科	307,647.00	0.51
7	002901	大博医疗	296,369.00	0.49
8	603599	广信股份	280,791.00	0.47
9	600012	皖通高速	268,324.00	0.45
10	600763	通策医疗	265,084.00	0.44
11	300511	雪榕生物	255,078.00	0.43
12	600261	阳光照明	251,526.00	0.42
13	600279	重庆港九	248,730.00	0.41
14	600072	中船科技	245,890.00	0.41
15	002104	恒宝股份	241,653.00	0.40
16	002267	陕天然气	233,997.00	0.39
17	002091	江苏国泰	231,485.00	0.39
18	601789	宁波建工	221,392.00	0.37

19	000910	大亚圣象	220,350.00	0.37
20	002577	雷柏科技	214,889.00	0.36

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。

### 7.4.3 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	29,413,319.59
卖出股票收入（成交）总额	31,424,221.03

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。

### 7.5 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	4,291,272.40	25.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,021,000.00	6.06
	其中：政策性金融债	1,021,000.00	6.06
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）	3,397.10	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,315,669.50	31.54

### 7.6 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	019303	13 国债 03	25,000	2,513,000.00	14.91
2	010303	03 国债(3)	11,470	1,160,075.80	6.88
3	018006	国开 1702	10,000	1,021,000.00	6.06
4	010107	21 国债(7)	6,000	617,280.00	3.66
5	127011	中鼎转 2	20	2,107.60	0.01

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 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。

**7.9 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**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指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）	风险说明
IC1909	中证 500 股指期货 1909	1	962,720.00	1,440.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,440.00
股指期货投资本期收益（元）					871,029.13
股指期货投资本期公允价值变动（元）					249,920.00

**7.10.2 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。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 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。

**7.11.2 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
T1909	10年期国债	2	1,941,550.00	8,350.00	-

	期货1909			
公允价值变动总额合计（元）				8,350.00
国债期货投资本期收益（元）				2,087.38
国债期货投资本期公允价值变动（元）				8,350.00

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货投资有效降低了基金净值波动，为基金的久期控制提供了更便利、更具有流动性的工具，为基金创造了一定的收益。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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

#### 7.12.2 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。

#### 7.12.3 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	187,698.04
2	应收证券清算款	100,184.11
3	应收股利	-
4	应收利息	65,041.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	352,923.84

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
244	63,864.63	339,592.49	2.18%	15,243,377.53	97.82%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	797,775.18	5.12%

### 8.3 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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2018 年 7 月 20 日 ）基金份额总额	234, 129, 606. 83
本报告期期初基金份额总额	60, 511, 453. 66
本报告期基金总申购份额	352, 874. 09
减：本报告期基金总赎回份额	45, 281, 357. 73
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	15, 582, 970. 02

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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 2019 年 4 月 27 日发布公告，自 2019 年 4 月 26 日起，渤海汇金证券资产管理有限公司的总理由周磊先生变更为徐海军先生代任。

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。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，投资策略无变化

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	60,837,540.62	100.00%	61,887.71	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、报告的及时性及服务质量；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。

### 10.7.2 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	10,956,650.40	100.00%	209,100,000.00	100.00%	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

注：无。

### 11.2 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 8 月 27 日