

渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券 投资基金清算报告

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2022年11月28日

清算报告公告日：2022年12月08日

§ 1 重要提示

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〕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注册的批复》准予注册。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基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于2018年7月20日正式生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规规定及《基金合同》约定，本基金以通讯方式组织召开了渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会（以下简称“第一次持有人大会”），审议《关于终止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有关事项的议案》。由于本人直接或委托授权代表出具有效表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额未达到第一次持有人大会权益登记日基金份额总数的1/2（含1/2），未达到法定的持有人会议召开条件，故第一次基金份额持有人大会召开失败。根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》和《渤海汇金证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》的有关规定，本基金以通讯方式二次召开渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，再次审议原定议案，并于2022年11月16日表决通过了《关于终止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有关事项的议案》。会议决议自该日起生效，2022年11月23日为本基金最后运作日。基金管理人于2022年11月18日披露了《渤海汇金证券资产管理有限公司关于渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会（二次召开）表决结果暨决议生效的公告》。

本基金从2022年11月24日起进入清算期，由基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成了基金财产清算小组，履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金概况

基金名称	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	渤海汇金量化汇盈混合
场内简称	-
交易代码	005021
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
报告期末（2022年11月23日）基金份额总额	708,516.12份
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> <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</p>

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，参与股指期货的投资。本基金将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，选择流动性较强、交易活跃的期货合约进行空头或多头套期保值，以管理投资组合的系统性风险，提高资金使用效率。

基金管理人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

	<p>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： 本基金将通过对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 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。本基金将通过对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。
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

§ 3 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可（2018）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注册的批复》准予注册，由渤海汇金证券资产管理有限公司管理，并依照法律法规、《基金合同》等规定自2018年5月22日至2018年7月17日公开募集。《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（含利息结转份额）总额为234,129,606.83份。

自2018年7月20日至2022年11月23日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》等有关规定，本基金基金份额持有人大会于 2022 年 11 月 16 日表决通过了《关于终止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有关事项的议案》，本基金自 2022 年 11 月 24 日进入清算期。

§ 4 财务会计报告

4.1 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 11 月 23 日

单位：人民币元

	最后运作日 2022 年 11 月 23 日
资产：	
银行存款	379,559.46
结算备付金	9,004.22
存出保证金	729.78
应收清算款	522,436.86
资产总计	911,730.32
负债和净资产	
负债：	
应付赎回款	195,566.58
应付管理人报酬	939.87
应付托管费	156.64
其他负债	6,247.44
负债合计	202,910.53
净资产：	
实收基金	708,516.12
未分配利润	303.67
净资产合计	708,819.79
负债和净资产总计	911,730.32

注：截至最后运作日 2022 年 11 月 23 日，基金份额净值 1.0004 元，基金份额总额 708,516.12 份。

§ 5 清算情况

清算期间自 2022 年 11 月 24 日至 2022 年 11 月 28 日止，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及清算期间的清算损益情况如下：

5.1 清算费用

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

5.2 资产处置情况

5.2.1 本基金最后运作日银行存款及其应计利息总和为人民币 379,559.46 元，其中托管账户存款为 379,522.08 元，应计银行存款利息为 37.38 元。应计利息款项将于结息后划入本基金托管账户。

5.2.2 本基金最后运作日结算备付金及其应计利息总和为人民币 9,004.22 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金为人民币 5,723.41 元，对应应计结算备付金利息为 12.36 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金为人民币 3,258.43 元，对应应计结算备付金利息为 10.02 元。应计利息款项将于结息后划入本基金托管账户。

5.2.3 本基金最后运作日存出保证金及其应计利息总和为人民币 729.78 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为 322.76 元，应计利息为 0.84 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为 404.90 元，应计利息为 1.28 元。应计利息款项将于结息后划入本基金托管账户。

5.2.4 本基金最后运作日应收清算款为人民币 522,436.86 元,该款项已于 2022 年 11 月 24 日收回并划入本基金银行存款活期账户。

5.3 负责清偿情况

5.3.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 195,566.58 元,该款项已于 2022 年 11 月 25 日支付完毕。

5.3.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 939.87 元,该款项已于 2022 年 11 月 24 日支付。

5.3.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 156.64 元,该款项已于 2022 年 11 月 24 日支付。

5.3.4 本基金最后运作日其他负债为人民币 6,247.44 元。其中,应付赎回费为人民币 0.79 元,该款项已于 2022 年 11 月 24 日支付;预提审计费为人民币 5,000.00 元,该款项已于 2022 年 11 月 25 日支付;应付交易费用为人民币 1,246.65 元,该款项已于 2022 年 11 月 24 日支付。

5.4 清算期间的损益情况

单位:人民币元

项目	金额
一、清算期间收益	37.97
二、清算期间费用	-84.00
三、清算期间净收益	-46.03

注:1) 清算期间收益为自 2022 年 11 月 24 日至 2022 年 11 月 28 日止清算期间的银行存款、结算备付金、保证金利息收入。

2) 清算期间费用为银行划款手续费。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位:人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 11 月 23 日基金净资产	708,819.79
加:清算期间净收益	-46.03
减:基金净赎回金额(于 2022 年 11 月 24 日确认的投资者赎回申请)	16,816.72
二、清算结束日 2022 年 11 月 28 日基金净资产	691,957.04

资产处置及负债清偿后，本基金 2022 年 11 月 28 日归属于剩余基金份额持有人的净资产为人民币 691,957.04 元，其中剩余未到账资产为人民币 9,809.35 元，包括结算备付金人民币 8,981.84 元，存出保证金人民币 727.66 元，应计银行存款、结算备付金、存出保证金利息人民币 99.85 元。支付清算款之日前未到账的部分，将由基金管理人以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

自清算期结束日次日（2022 年 11 月 29 日）至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的银行存款、结算备付金、存出保证金孳生的利息归基金份额持有人所有，最终支付清算款金额以本基金登记机构的记录为准。基金管理人垫付的资金自资金到账日起至托管账户销户为止孳生的利息归基金管理人所有，在托管账户销户前向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

5.6 基金财产清算报告的告知及剩余财产分配安排

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

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于〈渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告〉的法律意见》

6.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

6.3 查阅方式

上述文件可在营业时间内到渤海汇金证券资产管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-5988/400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2022年11月28日