

渤海汇金量化成长混合型发起式 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：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2025年1月8日

清算报告公告日：2025年1月17日

§ 1 重要提示

渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金（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〔2020〕3170号文准予注册。经向中国证监会备案，《渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于2021年12月28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，《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

本基金《基金合同》生效日为2021年12月28日，《基金合同》生效之日起三年后的对应日为2024年12月28日。截至2024年12月28日，本基金的基金资产净值低于2亿元，已触发上述《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，基金管理人将根据相关法律法规、《基金合同》等规定对本基金进行清算，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人于2024年12月28日披露了《关于渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金从2024年12月29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、基金托管人交通银行股份有限公司、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	渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金
基金简称	渤海汇金量化成长混合
基金主代码	005536
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月28日
基金最后运作日（2024年12月28	12,751,057.61份

日) 基金份额总额	
投资目标	本基金通过构建数量化投资策略,重点选择具备高成长潜力的优质上市公司,在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金为混合型基金,其股票投资比例占基金资产的比例为60%-95%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内,本基金将结合国内外宏观经济走势、财政货币政策、证券市场发展趋势等因素,合理的分配股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>(1) 基本面量化策略: 深入研究优质成长股具有的财务基本面特征,并将其进行数量化表达,形成基于基本面的量化投资体系。基本面特征包括但不限于估值、营收、盈利、杠杆、周转率等。通过该体系,筛选基本面优秀,或者基本面正在好转的成长股构建投资组合。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(三) 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。</p> <p>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。</p> <p>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。可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新</p>

	<p>发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。</p> <p>（四）股指期货投资策略</p> <p>本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为目的，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>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>（五）国债期货投资策略</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>（六）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>	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	渤海汇金量化成长混合 A	渤海汇金量化成长混合 C
下属分级基金的交易代码	005536	021384
基金最后运作日（2024 年 12 月 28 日）下属分级基金的份额总额	12,662,783.88 份	88,273.73 份

§ 3 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可〔2020〕3170 号文准予注册，由渤海汇金证券资产管理有限公司管理，经中国证监会机构部函〔2021〕2850 号《关于渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金延期募集备案的回函》准予延期募集，依照法律法规、《基金合同》等规定自 2021 年 12 月

13日至2021年12月24日公开募集。《基金合同》于2021年12月28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61,098,365.18份。

自2021年12月28日至2024年12月28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，基金管理人于2024年12月28日披露了《关于渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金最后运作日为2024年12月28日，自2024年12月29日起，本基金进入基金财产清算程序。

§ 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：渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年12月28日

单位：人民币元

	最后运作日 2024年12月28日
资产：	
货币资金	5,583,455.86
交易性金融资产	7,390,360.20
其中：股票投资	7,390,360.20
资产总计	12,973,816.06
负债和净资产	
负债：	
应付赎回款	2,422,073.83
应付管理人报酬	18,531.16
应付托管费	3,088.53
应付销售服务费	94.80
其他负债	8.64
负债合计	2,443,796.96
净资产：	
实收基金	12,751,057.61

未分配利润	-2,221,038.51
净资产合计	10,530,019.10
负债和净资产总计	12,973,816.06

注：截至最后运作日 2024 年 12 月 28 日，渤海汇金量化成长混合 A 基金份额净值 0.8258 元，基金份额总额 12,662,783.88 份；渤海汇金量化成长混合 C 基金份额净值 0.8226 元，基金份额总额 88,273.73 份。渤海汇金量化成长混合基金份额总额合计为 12,751,057.61 份。

§ 5 清算情况

清算期间自 2024 年 12 月 29 日至 2025 年 1 月 8 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剩余财产中支付。

5.2 资产处置情况

5.2.1 本基金最后运作日货币资金为人民币 5,583,455.86 元，其中存放于渤海证券股份有限公司证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金为人民币 5,582,574.77 元，对应应计利息为 278.55 元，上述货币资金在清算期间已完成结息并划转至银行托管户；存放于托管人交通银行股份有限公司的资金为人民币 602.48 元，对应应计利息为 0.06 元。

5.2.2 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 7,390,360.20 元，全部为股票投资。该资产已于清算期全部变现，变现所产生的证券清算款为人民币 7,284,720.75 元，该款项已于 2025 年 1 月 2 日划入托管户。

5.3 负债清偿情况

5.3.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,422,073.83 元，该款项已于 2025 年 1 月 2 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 18,531.16 元，该款项已于 2025 年 1 月 2 日支付。

5.3.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,088.53 元，该款项已于 2025 年 1 月 2 日支付。

5.3.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 94.80 元，该款项已于 2025 年 1 月 2 日支付。

5.3.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 8.64 元，为应付赎回费，该款项已于 2025 年 1 月 2 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	-104,529.42
1、利息收入（注 1）	1,056.32
2、投资收益（注 2）	437,147.76
3、公允价值变动损益	-542,787.21
4、其他收入（注 3）	53.71
二、清算期间费用	8,000.00
1、律师费	8,000.00
三、清算期间净收益	-112,529.42

注：1) 利息收入为自 2024 年 12 月 29 日至 2025 年 1 月 8 日止清算期间的货币资金利息收入。

2) 投资收益为自 2024 年 12 月 29 日至 2025 年 1 月 8 日止清算期间的股票变现收益。

3) 其他收入为自 2024 年 12 月 29 日至 2025 年 1 月 8 日止清算期间的赎回费收入。

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 2024 年 12 月 28 日基金净资产	10,530,019.10
加：清算期间净收益	-112,529.42
减：基金净赎回金额（于 2024 年 12 月 30 日确认的投资者	1,561,568.44

赎回申请)	
二、清算结束日 2025 年 1 月 8 日基金净资产	8,855,921.24

资产处置及负债清偿后，本基金 2025 年 1 月 8 日归属于剩余基金份额持有人的基金净资产为人民币 8,855,921.24 元，其中剩余未到账资产为人民币 602.73 元，均为货币资金应计利息。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（2025 年 1 月 9 日）至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的货币资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、《渤海汇金量化成长混合型发起式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〈渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金清算报告〉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：400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2025年1月8日