

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

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 重要提示及目录

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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57

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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	-
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</p>

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。

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：

	<p>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。</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： 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 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。

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/ 400-651-1717	95588
传真		022-23861651	010-66105798
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市南山区海德三道19号海岸大厦西座2901室	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518052	100140
法定代表人		徐海军	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	https://www.bhhjamc.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	渤海汇金证券资产管理有限公司	天津市南开区宾水西道8号

§ 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
本期加权平均净值利润率	12.51%
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)
期末可供分配利润	1,271,201.31
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	8.16%

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

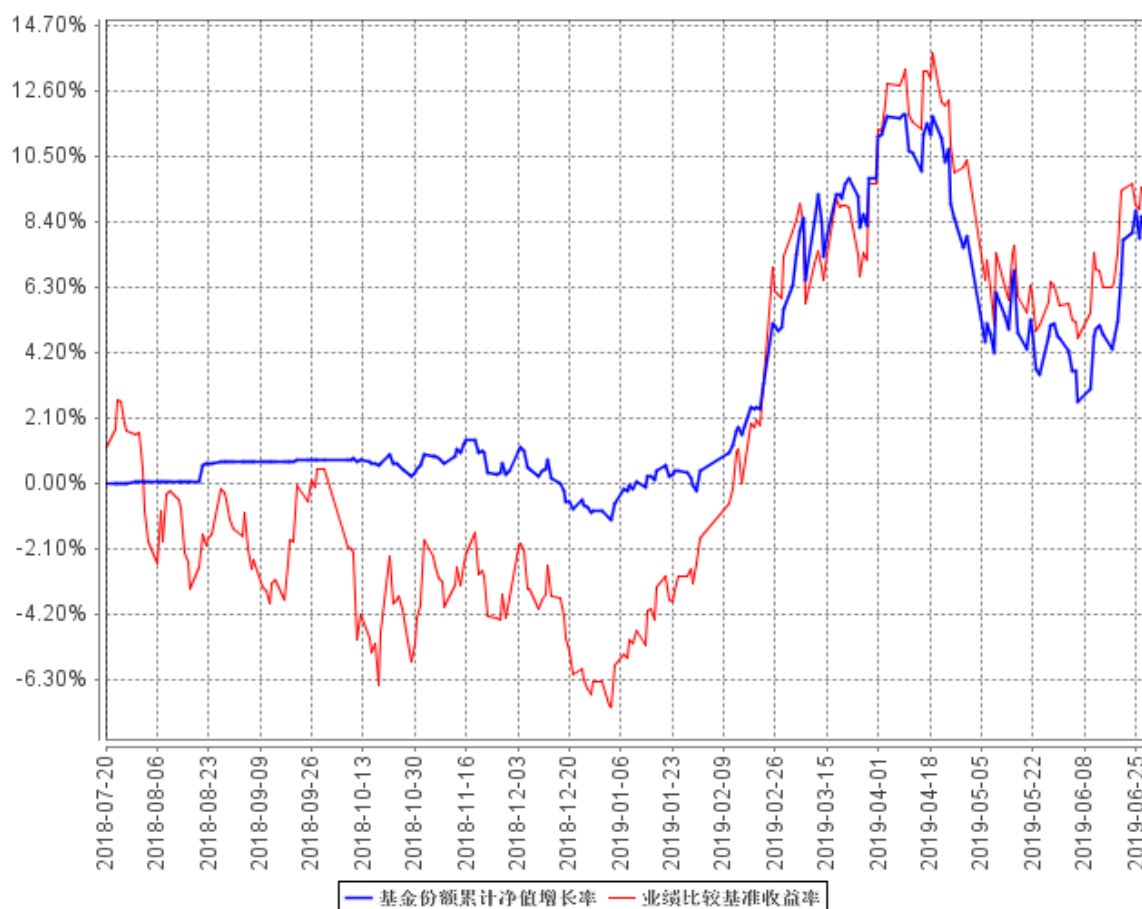
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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。

3.3 其他指标

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	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	800,000.00	17,400,000.00
应收证券清算款		100,184.11	6,499.48
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,983,319.50	60,264,086.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	72,914.56	135,134.79
负债合计		129,148.17	296,296.37
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	15,582,970.02	60,511,453.66
未分配利润	6.4.7.10	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	附注号	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
一、收入		4,504,468.02	-
1.利息收入		359,067.72	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	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	6.4.7.12	1,549,049.37	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	33,200.50	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	873,116.51	-
股利收益	6.4.7.16	64,076.26	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	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）	6.4.7.18	32,537.80	-
减：二、费用		473,799.47	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	245,490.79	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	40,915.08	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	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	6.4.7.20	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		

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
----	-------------------

活期存款	85,785.27
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	85,785.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,950,640.27	9,654,943.34	704,303.07
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,289,064.43	5,315,669.50
	银行间市场	-	-
	合计	5,289,064.43	5,315,669.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	14,239,704.70	14,970,612.84	730,908.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金 额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	1,941,550.00	-	-	
国债期货投资	1,941,550.00	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	961,280.00	-	-	
股指期货投资	961,280.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,902,830.00	-	-	

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 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 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	800,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	21.58
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	58.60
应收债券利息	64,826.05
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	133.56
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.90
合计	65,041.69

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	30,455.65

银行间市场应付交易费用	-
合计	30,455.65

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.00
预提费用	72,912.56
合计	72,914.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,511,453.66	60,511,453.66
本期申购	352,874.09	352,874.09
本期赎回(以“-”号填列)	-45,281,357.73	-45,281,357.73
- 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	15,582,970.02	15,582,970.02

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	293,757.04	-837,420.23	-543,663.19
本期利润	2,437,248.69	1,593,419.86	4,030,668.55
本期基金份额交易产生的变动数	-1,250,660.31	-965,143.74	-2,215,804.05
其中：基金申购款	22,128.16	-172.58	21,955.58
基金赎回款	-1,272,788.47	-964,971.16	-2,237,759.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,480,345.42	-209,144.11	1,271,201.31

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	2,089.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,348.33
其他	36.78
合计	4,474.29

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	31,424,221.03
减：卖出股票成本总额	29,875,171.66
买卖股票差价收入	1,549,049.37

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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	33,200.50
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	33,200.50

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	38,771,338.16
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	38,027,178.77
减：应收利息总额	710,958.89
买卖债券差价收入	33,200.50

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	2,087.38
股指期货-投资收益	871,029.13

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	64,076.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	64,076.26

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,335,149.86
——股票投资	1,388,322.89
——债券投资	-53,173.03
——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	258,270.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	1,593,419.86

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	32,537.80
合计	32,537.80

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	99,283.77
银行间市场交易费用	350.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	99,633.77

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	44,076.77
银行汇划费用	2,104.04
银行间账户维护费	18,600.00
合计	84,616.60

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告报出日，本基金无需说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 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%	-	-

6.4.10.1.2 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%	-	-

6.4.10.1.3 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%	-	-
------	----------------	---------	---	---

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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。

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，理论上其风险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。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立以董事会为风险管理的最高决策机构，以经营层负责风险管理主体责任，以首席风险官负责风险管理工作具体推动落实，以风险管理委员会为风险管理工作指导机构，由专职的风险控制部门为风险管理的督导执行部门，由管理、支持与保障部门及业务部门、各分支机构为风险管理的具体落实部门的多层级的全面风险管理体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	0.00	19,511,000.00
合计	0.00	19,511,000.00

注：未评级债券是未有第三方评级的银行间同业存单

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	3,397.10	-
未评级	5,312,272.40	11,426,951.30
合计	5,315,669.50	11,426,951.30

注：未评级债券为国债及政策性金融债等免评级债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金为混合型基金，于 2019 年 6 月 30 日，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，评估结果显示本基金组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	85,785.27	-	-	-	-	-	85,785.27
结算备付金	773,997.55	-	-	-	-	-	773,997.55
存出保证金	4,169.74	-	-	-	-	183,528.30	187,698.04
交易性金融 资产	-	-	-2,516,397.10	2,798,355.80	916.60	9,654,943.34	14,970,612.84
买入返售金 融资产	800,000.00	-	-	-	-	-	800,000.00
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	100,184.11	100,184.11
应收利息	-	-	-	-	-	65,041.69	65,041.69
资产总计	1,663,952.56	-	-2,516,397.10	2,798,355.80	916.60	10,003,697.44	16,983,319.50
负债							
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	9,790.00	9,790.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,064.88	1,064.88
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	21,122.51	21,122.51
应付托管费	-	-	-	-	-	3,520.40	3,520.40
应付交易费 用	-	-	-	-	-	30,455.65	30,455.65
应交税费	-	-	-	-	-	70.17	70.17
其他负债	-	-	-	-	-	63,124.56	63,124.56
负债总计	-	-	-	-	-	129,148.17	129,148.17
利率敏感度 缺口	1,663,952.56	-	-2,516,397.10	2,798,355.80	916.60	9,874,549.27	16,854,171.33
上年度末 2018年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	239,748.62	-	-	-	-	-	239,748.62
结算备付金	1,568,760.18	-	-	-	-	-	1,568,760.18
存出保证金	2,451.80	-	-	-	-	775,219.20	777,671.00
交易性金融 资产	9,668,000.00	9,843,000.00	3,751,100.40	7,674,935.40	915.50	8,715,491.00	39,653,442.30
买入返售金 融资产	17,400,000.00	-	-	-	-	-	-17,400,000.00

应收证券清算款						254,979.48	254,979.48
应收利息						617,965.26	617,965.26
其他资产						-248,480.00	-248,480.00
资产总计	28,878,960.60	9,843,000.00	3,751,100.40	7,674,935.40	915.50	10,115,174.94	60,264,086.84
负债							
应付赎回款						53,651.70	53,651.70
应付管理人报酬						77,715.19	77,715.19
应付托管费						12,952.53	12,952.53
应付交易费用						16,842.16	16,842.16
其他负债						135,134.79	135,134.79
负债总计						296,296.37	296,296.37
利率敏感度缺口	28,878,960.60	9,843,000.00	3,751,100.40	7,674,935.40	915.50	9,818,878.57	59,967,790.47

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-1.12	-2.84
市场利率下降 25 个基点	1.13	2.90	

注：单位：万元

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	9,654,943.34	57.29	8,715,491.00	14.53
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	5,315,669.50	31.54	30,937,951.30	51.59
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	14,970,612.84	88.82	39,653,442.30	66.12

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	26.21	27.21
业绩比较基准下降5%	-26.21	-27.21	

注：单位：万元

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 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所有股票投资明细

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
11	600988	赤峰黄金	19,800	121,176.00	0.72
12	600519	贵州茅台	100	98,400.00	0.58
13	300015	爱尔眼科	3,090	95,697.30	0.57
14	603039	泛微网络	1,200	89,040.00	0.53
15	601318	中国平安	1,000	88,610.00	0.53
16	000035	中国天楹	14,700	88,200.00	0.52
17	300098	高新兴	9,800	78,204.00	0.46
18	600490	鹏欣资源	15,800	78,052.00	0.46
19	300630	普利制药	1,350	77,787.00	0.46
20	300034	钢研高纳	5,200	77,168.00	0.46
21	600456	宝钛股份	3,300	75,273.00	0.45
22	000034	神州数码	5,700	73,530.00	0.44
23	600269	赣粤高速	16,500	73,260.00	0.43
24	300533	冰川网络	1,900	68,932.00	0.41
25	601595	上海电影	4,800	68,640.00	0.41

26	300624	万兴科技	1,400	67,522.00	0.40
27	600887	伊利股份	2,000	66,820.00	0.40
28	600602	云赛智联	8,700	66,729.00	0.40
29	600090	同济堂	13,900	65,052.00	0.39
30	002349	精华制药	11,000	65,010.00	0.39
31	300232	洲明科技	6,601	63,897.68	0.38
32	600546	山煤国际	11,800	63,484.00	0.38
33	600211	西藏药业	2,000	63,320.00	0.38
34	300315	掌趣科技	18,300	63,135.00	0.37
35	002462	嘉事堂	4,200	63,000.00	0.37
36	300750	宁德时代	900	61,992.00	0.37
37	300215	电科院	9,800	61,446.00	0.36
38	601222	林洋能源	13,000	60,970.00	0.36
39	600681	百川能源	8,100	60,264.00	0.36
40	600063	皖维高新	20,900	58,520.00	0.35
41	603303	得邦照明	6,500	58,110.00	0.34
42	002273	水晶光电	5,000	57,900.00	0.34
43	601163	三角轮胎	4,600	57,684.00	0.34
44	601369	陕鼓动力	8,700	57,681.00	0.34
45	600162	香江控股	23,400	57,096.00	0.34
46	000822	山东海化	11,200	56,896.00	0.34
47	300438	鹏辉能源	3,500	56,630.00	0.34
48	002313	日海通讯	2,800	56,560.00	0.34
49	600320	振华重工	15,000	56,400.00	0.33
50	000059	华锦股份	8,800	56,320.00	0.33
51	603773	沃格光电	1,800	56,304.00	0.33
52	002101	广东鸿图	7,200	55,080.00	0.33
53	000651	格力电器	1,000	55,000.00	0.33
54	000869	张裕A	1,700	54,604.00	0.32
55	603165	荣晟环保	2,900	54,433.00	0.32
56	600239	云南城投	18,700	54,230.00	0.32
57	000016	深康佳A	12,900	54,180.00	0.32
58	002574	明牌珠宝	9,200	54,004.00	0.32
59	600036	招商银行	1,500	53,970.00	0.32
60	603730	岱美股份	2,300	53,912.00	0.32
61	002031	巨轮智能	25,200	52,920.00	0.31
62	300124	汇川技术	2,300	52,693.00	0.31
63	600702	舍得酒业	1,800	48,924.00	0.29
64	300408	三环集团	2,500	48,625.00	0.29

65	601366	利群股份	7,700	48,279.00	0.29
66	000672	上峰水泥	3,900	47,853.00	0.28
67	600030	中信证券	2,000	47,620.00	0.28
68	002234	民和股份	1,700	47,583.00	0.28
69	002135	东南网架	8,500	47,090.00	0.28
70	002061	浙江交科	7,600	45,448.00	0.27
71	002458	益生股份	2,300	44,873.00	0.27
72	300003	乐普医疗	1,900	43,738.00	0.26
73	300142	沃森生物	1,500	42,540.00	0.25
74	600987	航民股份	6,400	42,304.00	0.25
75	300017	网宿科技	3,900	42,042.00	0.25
76	603288	海天味业	400	42,000.00	0.25
77	300136	信维通信	1,700	41,565.00	0.25
78	002475	立讯精密	1,600	39,664.00	0.24
79	300014	亿纬锂能	1,300	39,598.00	0.23
79	300024	机器人	2,600	39,598.00	0.23
80	603899	晨光文具	900	39,573.00	0.23
81	600588	用友网络	1,440	38,707.20	0.23
82	002032	苏泊尔	500	37,915.00	0.22
83	601100	恒立液压	1,200	37,656.00	0.22
84	002311	海大集团	1,200	37,080.00	0.22
85	300253	卫宁健康	2,600	36,868.00	0.22
86	600500	中化国际	4,900	36,603.00	0.22
87	002399	海普瑞	1,700	35,683.00	0.21
88	300244	迪安诊断	2,100	35,658.00	0.21
89	600031	三一重工	2,700	35,316.00	0.21
90	002317	众生药业	4,100	34,891.00	0.21
91	600582	天地科技	10,100	34,845.00	0.21
92	600169	太原重工	13,000	34,710.00	0.21
93	600572	康恩贝	5,400	34,560.00	0.21
94	300122	智飞生物	800	34,480.00	0.20
95	002489	浙江永强	10,300	34,402.00	0.20
96	600657	信达地产	8,300	34,196.00	0.20
97	600570	恒生电子	500	34,075.00	0.20
98	000661	长春高新	100	33,800.00	0.20
99	300450	先导智能	1,000	33,600.00	0.20
100	300383	光环新网	2,000	33,540.00	0.20
101	600409	三友化工	5,900	33,394.00	0.20
102	000537	广宇发展	4,800	33,216.00	0.20

103	002004	华邦健康	6,800	33,048.00	0.20
104	600325	华发股份	4,200	32,802.00	0.19
105	300760	迈瑞医疗	200	32,640.00	0.19
106	600021	上海电力	3,700	32,116.00	0.19
107	600801	华新水泥	1,560	31,590.00	0.19
108	002416	爱施德	5,000	31,250.00	0.19
109	000543	皖能电力	6,600	31,086.00	0.18
110	300347	泰格医药	400	30,840.00	0.18
111	002384	东山精密	2,100	30,597.00	0.18
112	300308	中际旭创	900	30,591.00	0.18
113	600820	隧道股份	4,700	29,657.00	0.18
114	300033	同花顺	300	29,508.00	0.18
115	002920	德赛西威	1,300	29,120.00	0.17
116	300146	汤臣倍健	1,500	29,100.00	0.17
117	600200	江苏吴中	4,900	28,812.00	0.17
118	601019	山东出版	3,700	28,786.00	0.17
119	000997	新大陆	1,700	28,713.00	0.17
120	603025	大豪科技	2,800	28,672.00	0.17
121	000049	德赛电池	1,100	28,633.00	0.17
122	600717	天津港	4,440	28,504.80	0.17
123	601179	中国西电	7,700	28,490.00	0.17
124	600350	山东高速	5,900	28,320.00	0.17
125	601801	皖新传媒	4,700	28,247.00	0.17
126	300376	易事特	5,700	28,101.00	0.17
127	300070	碧水源	3,600	28,044.00	0.17
128	000860	顺鑫农业	600	27,990.00	0.17
129	600276	恒瑞医药	420	27,720.00	0.16
130	000158	常山北明	5,100	27,642.00	0.16
131	600755	厦门国贸	3,200	27,616.00	0.16
132	002507	涪陵榨菜	900	27,450.00	0.16
133	000666	经纬纺机	2,200	27,390.00	0.16
134	000426	兴业矿业	5,100	27,387.00	0.16
135	601688	华泰证券	1,200	26,784.00	0.16
136	002280	联络互动	7,100	25,986.00	0.15
137	600597	光明乳业	2,400	25,800.00	0.15
138	600699	均胜电子	1,200	25,632.00	0.15
139	600346	恒力石化	2,100	25,536.00	0.15
140	002493	荣盛石化	2,100	25,326.00	0.15
141	600009	上海机场	300	25,134.00	0.15

142	600673	东阳光	3,200	25,120.00	0.15
143	600498	烽火通信	900	25,074.00	0.15
143	603198	迎驾贡酒	1,400	25,074.00	0.15
144	600900	长江电力	1,400	25,060.00	0.15
145	600598	北大荒	2,300	24,679.00	0.15
146	300413	快乐购	600	24,630.00	0.15
147	601168	西部矿业	3,800	24,244.00	0.14
148	600282	南钢股份	6,900	24,150.00	0.14
149	000932	华菱钢铁	5,040	24,040.80	0.14
150	000333	美的集团	461	23,907.46	0.14
151	000858	五粮液	200	23,590.00	0.14
152	300088	长信科技	4,600	23,276.00	0.14
153	000686	东北证券	2,600	22,906.00	0.14
154	002299	圣农发展	900	22,788.00	0.14
155	601088	中国神华	1,100	22,418.00	0.13
156	600426	华鲁恒升	1,500	22,290.00	0.13
157	002583	海能达	2,600	21,814.00	0.13
158	600309	万华化学	500	21,395.00	0.13
159	600291	西水股份	2,100	21,126.00	0.13
160	600585	海螺水泥	500	20,750.00	0.12
161	300072	三聚环保	2,600	20,618.00	0.12
162	600760	中航沈飞	700	20,321.00	0.12
163	000723	美锦能源	1,900	19,855.00	0.12
164	603019	中科曙光	560	19,656.00	0.12
165	603355	莱克电气	900	19,368.00	0.11
166	601777	力帆股份	4,500	19,305.00	0.11
167	000898	鞍钢股份	5,070	19,215.30	0.11
168	600028	中国石化	3,500	19,145.00	0.11
169	300009	安科生物	1,200	19,080.00	0.11
170	300170	汉得信息	1,400	19,026.00	0.11
171	002508	老板电器	700	18,998.00	0.11
172	300357	我武生物	560	18,995.20	0.11
173	600837	海通证券	1,300	18,447.00	0.11
174	300073	当升科技	800	18,376.00	0.11
175	600660	福耀玻璃	800	18,184.00	0.11
176	000519	中兵红箭	2,300	17,779.00	0.11
177	300316	晶盛机电	1,400	17,766.00	0.11
178	601888	中国国旅	200	17,730.00	0.11
179	300251	光线传媒	2,600	17,680.00	0.10

180	600690	青岛海尔	1,000	17,290.00	0.10
181	300027	华谊兄弟	3,500	17,185.00	0.10
182	600316	洪都航空	1,200	17,172.00	0.10
183	601211	国泰君安	900	16,515.00	0.10
184	300274	阳光电源	1,700	15,895.00	0.09
185	002050	三花智控	1,500	15,825.00	0.09
186	300601	康泰生物	300	15,750.00	0.09
187	300113	顺网科技	1,000	15,680.00	0.09
188	603156	养元饮品	400	14,832.00	0.09
189	300115	长盈精密	1,400	14,686.00	0.09
190	601601	中国太保	400	14,604.00	0.09
191	002443	金洲管道	2,000	14,380.00	0.09
192	300747	锐科激光	100	14,001.00	0.08
193	600809	山西汾酒	200	13,810.00	0.08
194	300433	蓝思科技	1,900	13,243.00	0.08
195	601128	常熟银行	1,700	13,124.00	0.08
196	600811	东方集团	3,500	13,020.00	0.08
197	300418	昆仑万维	1,000	12,870.00	0.08
198	600138	中青旅	1,000	12,690.00	0.08
199	000895	双汇发展	500	12,445.00	0.07
200	002304	洋河股份	100	12,156.00	0.07
201	600436	片仔癀	100	11,520.00	0.07
202	300676	华大基因	200	11,408.00	0.07
203	300377	赢时胜	1,000	11,320.00	0.07
204	600968	海油发展	3,000	10,650.00	0.06
205	002007	华兰生物	300	9,147.00	0.05
206	300182	捷成股份	2,000	8,820.00	0.05
207	300496	中科创达	300	8,724.00	0.05
208	603986	兆易创新	100	8,670.00	0.05
209	000538	云南白药	100	8,342.00	0.05
210	000568	泸州老窖	100	8,083.00	0.05
211	300134	大富科技	500	7,765.00	0.05
212	603877	太平鸟	500	7,760.00	0.05
213	300226	上海钢联	100	7,496.00	0.04
214	300038	梅泰诺	800	7,488.00	0.04
215	601012	隆基股份	320	7,395.20	0.04
216	300178	腾邦国际	1,200	7,380.00	0.04
217	002179	中航光电	220	7,361.20	0.04
218	300053	欧比特	700	6,986.00	0.04

219	600771	广誉远	360	6,984.00	0.04
220	002371	北方华创	100	6,925.00	0.04
221	300355	蒙草生态	1,500	6,150.00	0.04
222	300748	金力永磁	100	6,008.00	0.04
223	300618	寒锐钴业	100	6,000.00	0.04
224	300287	飞利信	1,500	5,955.00	0.04
225	300699	光威复材	180	5,886.00	0.03
226	300085	银之杰	400	5,676.00	0.03
227	300068	南都电源	500	5,650.00	0.03
228	300222	科大智能	400	5,208.00	0.03
229	603323	苏农银行	880	4,875.20	0.03
230	300666	江丰电子	100	3,792.00	0.02

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序的所有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年期国债期货1909	2	1,941,550.00	8,350.00	-
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。

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%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金增加北京植信基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	证券时报、公司网站	2019年1月15日
2	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金2018年第4季度报告	证券时报、公司网站	2019年1月18日
3	关于旗下部分基金增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	证券时报、公司网站	2019年2月22日
4	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(更新)摘要(2019年第1号)	证券时报、公司网站	2019年3月5日
5	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(更新)(2019年第1号)	公司网站	2019年3月5日
6	关于旗下部分基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	公司网站	2019年3月8日
7	关于旗下部分基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	证券时报	2019年3月12日

8	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告	公司网站	2019 年 3 月 28 日
9	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）	证券时报、公司网站	2019 年 3 月 28 日
10	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2019 年 4 月 22 日
11	2019 年度渤海汇金证券资产管理有限公司基金高级管理人员（总经理）变更公告	证券时报、公司网站	2019 年 4 月 27 日

§ 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《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》；
- 3、《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《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》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

12.3 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：400-651-5988/400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

渤海汇金证券资产管理有限公司

2019年8月27日