

# 渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	渤海汇金睿选混合
场内简称	-
交易代码	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
报告期末基金份额总额	12,982,419.89 份
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</p>

	<p>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： 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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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、</p>
--	--

	<p>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) 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。</p> <p>(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。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <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。</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，并通过研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的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。本基金将通过研究标的的证券基本面研究，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。	
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	
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
报告期末下属分级基金的份额总额	11,789,523.03 份	1,192,896.86 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）	
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
1. 本期已实现收益	224,703.86	23,787.26
2. 本期利润	-181,103.27	-22,668.32
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0145	-0.0168
4. 期末基金资产净值	15,674,872.25	1,550,741.74
5. 期末基金份额净值	1.3296	1.3000

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。

#### 3.2 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	净值增长率①	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	-1.22%	0.42%	-1.00%	0.36%	-0.22%	0.06%
过去六个月	2.69%	0.39%	0.68%	0.33%	2.01%	0.06%
过去一年	11.51%	0.43%	4.72%	0.37%	6.79%	0.06%
过去三年	30.88%	0.35%	23.08%	0.40%	7.80%	-0.05%

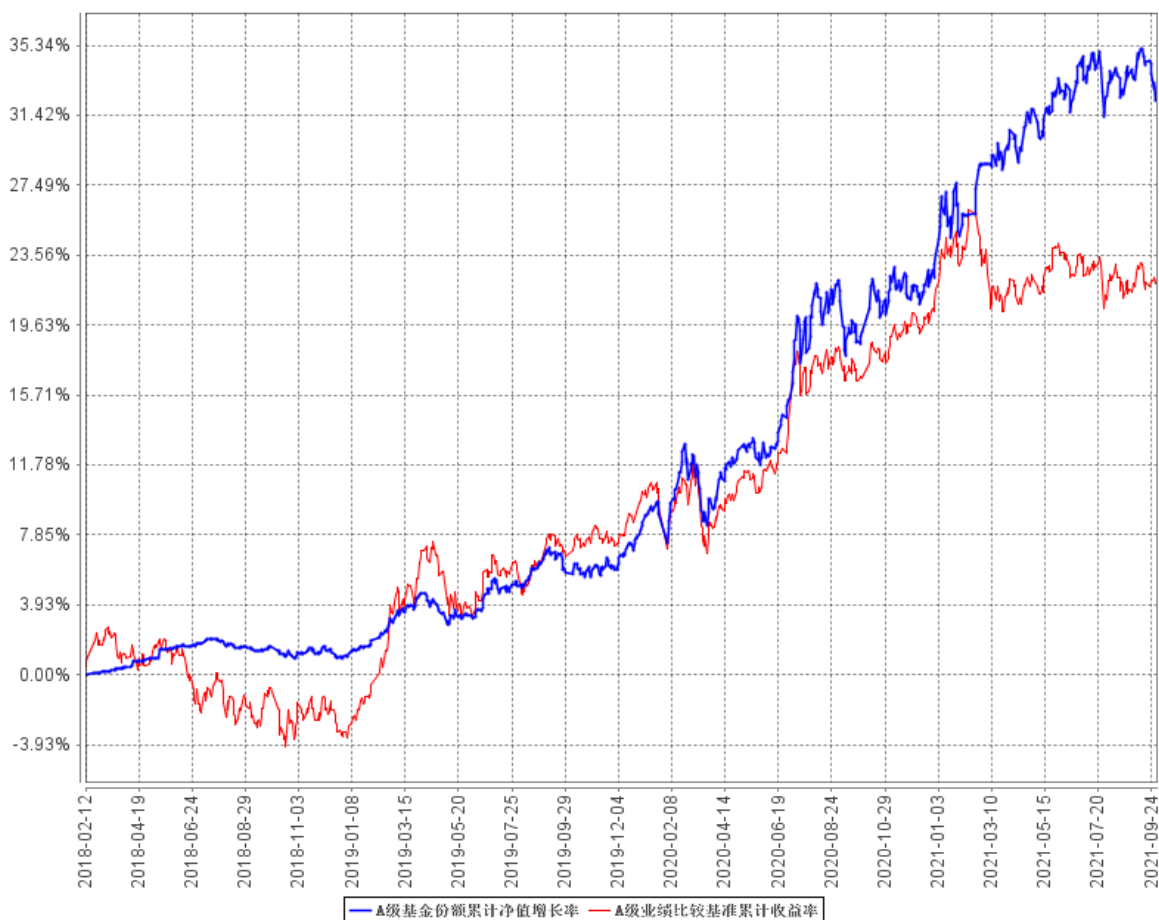
自基金合同生效起至今	32.96%	0.32%	22.21%	0.40%	10.75%	-0.08%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

渤海汇金睿选混合 C

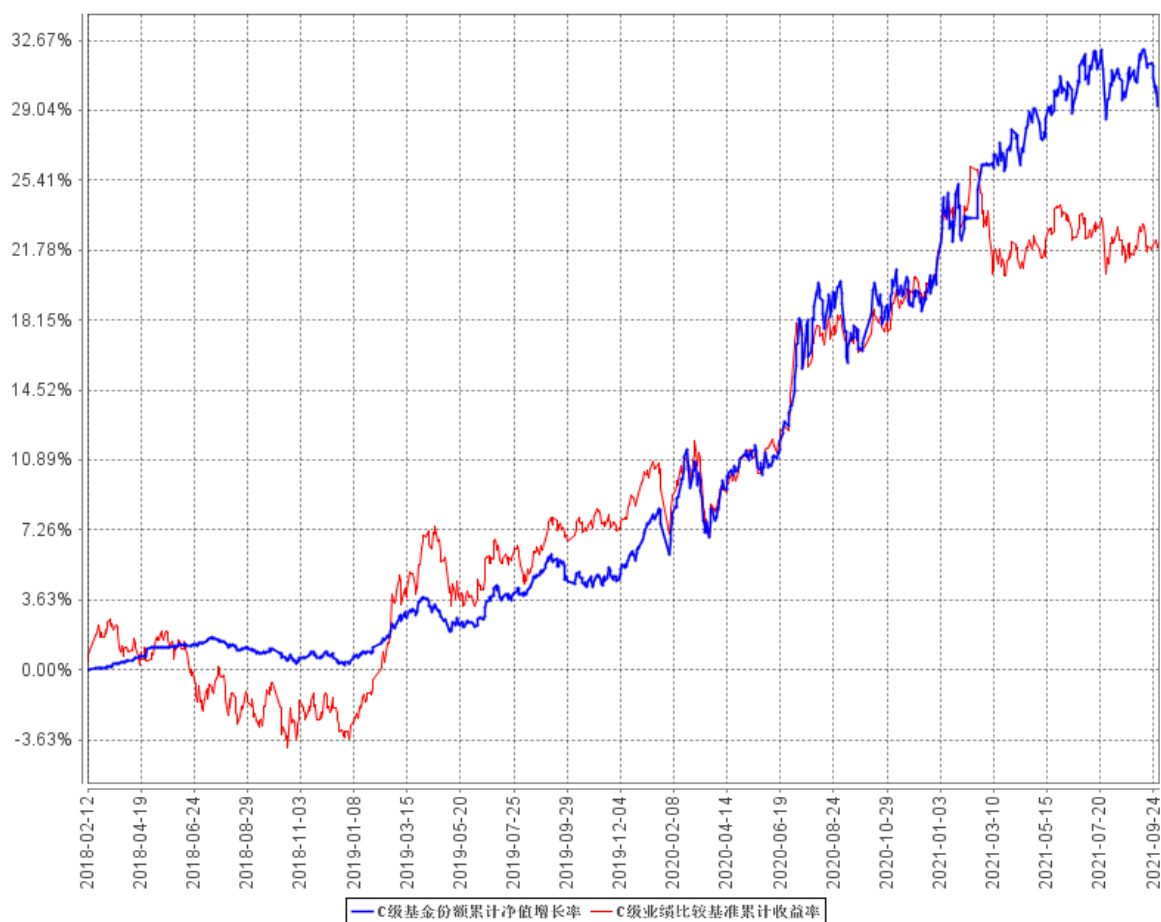
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.37%	0.42%	-1.00%	0.36%	-0.37%	0.06%
过去六个月	2.38%	0.39%	0.68%	0.33%	1.70%	0.06%
过去一年	10.91%	0.43%	4.72%	0.37%	6.19%	0.06%
过去三年	28.60%	0.35%	23.08%	0.40%	5.52%	-0.05%
自基金合同生效起至今	30.00%	0.32%	22.21%	0.40%	7.79%	-0.08%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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、本基金合同于 2018 年 2 月 11 日生效。

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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2018 年 2 月 11 日	-	17 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

	募 投 资 部 总 经 理				<p>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。2021年3月起担任渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金经理。</p>
李杨	本 基 金 的 基 金 经 理	2018 年 2 月 11 日	-	5 年	<p>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月至2021年8月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。2020年11月起担任渤海汇金汇裕87个月定开基金基金经理。2021年8月起任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。</p>

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 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 公平交易专项说明

##### 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，并通过恒生 032 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

##### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度利率债收益大幅下行，10 年国债收益下行 20bps，10 年国开下行 27bps。具体来看 7 月至 8 月初，收益处于快速下行阶段，主要触发因素包括经济及金融数据持续下滑，央行超预期降准以及地方债供给缓速，10 年国债从 7 月初的 3.08% 下行至 2.80% 附近。8 月中旬至 9 月末扰动因素增强，包括地方债供给加速，理财监管政策不断出台，大宗商品价格高企以及海外美联储 taper 临近对国内货币政策影响等，10 年国债收益从 2.8% 的低点小幅反弹至 2.87% 附近。

报告期内，债券持仓未作调整。主要持仓品种仍然是交易所利率债，无信用风险敞口。

三季度，市场再次调整，指数探底，随后市场震荡抬升，连续万亿成交表现，市场存量博弈格局之下，资金在各个板块中来回涌动，市场风格的快速轮动，主线开始从新能源车产业链向资源股切换，“跷跷板”效应显著。具体来看，三季度上证综指、沪深 300、中小 100、创业板指分别下跌 0.64%、6.85%、4.98%、6.69%。行业方面，采掘、公用事业、有色金属相对大幅上涨，而医药生物、休闲服务、食品饮料收跌。我们在渤海汇金睿选产品的投资运作中，一直坚持宏观分析与量化相结合的理念，并强化基金投资运作中资产配置的重要性。

三季度宏观经济缓和下行，财政和货币政策继续发挥逆周期调节作用，稳增长政策逐步落地，后续有望进一步加码；能耗双控约束下，节能减排与经济增长双重目标之间出现一定的矛盾，这种矛盾有望在政策纠偏下得到调和，保供稳价政策的效果会逐步显现。流动性边际继续小幅改善，且改善的趋势将会延续。风险偏好方面，三季度 A 股市场部分行业估值水平较高，但整体估值水平处于相对合理的范围内，叠加中美关系阶段性缓和一定程度上提振了风险偏好。

在三季度，我们坚定看好震荡格局中，部分权益资产较为确定的、高速的业绩增长所带来的市场结构性机会，基本维持睿选中权益仓位配置比例。行业配置方面，睿选坚持以长期向好的消费升级（食品饮料）、产业升级（医药生物）、科技创新（电子、计算机等）新经济相关行业进行配置。选股方面，基金以多风格多策略量化选股模型为基础配置股票组合，避免了单一策略的周期影响，并定期对选股策略进行再平衡，在长时间维度上获取组合配置带来的投资收益。

#### 4.5 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 1.3296 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.22%；截至本报告期末渤海汇金睿选混合 C 基金份额净值为 1.3000 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.37%；同期业绩比较基准收益率为-1.00%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，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 2021 年 2 月 22 日至 2021 年 9 月 30 日连续 152 个工作日基金资产净值低于 5000 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：将不断完善持续营销方案，加大对本基金的持续营销。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,631,044.00	32.57
	其中：股票	5,631,044.00	32.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,492,920.00	25.98
	其中：债券	4,492,920.00	25.98
	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	5,000,000.00	28.92
	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	2,105,107.41	12.17
8	其他资产	61,565.03	0.36
9	合计	17,290,636.44	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	120,585.00	0.70
C	制造业	3,875,878.00	22.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,963.00	0.48
E	建筑业	55,721.00	0.32
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	91,138.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	119,317.00	0.69
J	金融业	538,511.00	3.13
K	房地产业	155,563.00	0.90
L	租赁和商务服务业	131,726.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	365,592.00	2.12

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	94,050.00	0.55
S	综合	-	-
	合计	5,631,044.00	32.69

### 5.2.2 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300347	泰格医药	1,100	191,400.00	1.11
2	603259	药明康德	1,140	174,192.00	1.01
3	002202	金风科技	9,900	172,161.00	1.00
4	000002	万科 A	7,300	155,563.00	0.90
5	000898	鞍钢股份	31,800	152,958.00	0.89
6	600036	招商银行	3,000	151,350.00	0.88
7	600585	海螺水泥	3,600	146,880.00	0.85
8	601658	邮储银行	28,100	142,748.00	0.83
9	601318	中国平安	2,900	140,244.00	0.81
10	600690	海尔智家	5,300	138,595.00	0.80

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,450,920.00	8.42

2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,042,000.00	17.66
	其中：政策性金融债	3,042,000.00	17.66
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	4,492,920.00	26.08

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018006	国开 1702	20,000	2,016,200.00	11.70
2	018008	国开 1802	10,000	1,025,800.00	5.96
3	019601	18 国债 19	9,000	943,020.00	5.47
4	010303	03 国债 (3)	5,000	507,900.00	2.95

### 5.6 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

不适用

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.10.1 本期国债期货投资政策**

不适用

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

不适用

**5.11 投资组合报告附注****5.11.1 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**

本报告期内未发现本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

**5.11.2 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**

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,571.36
2	应收证券清算款	3,895.89
3	应收股利	-
4	应收利息	53,344.53
5	应收申购款	2,753.25
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	61,565.03

**5.11.4 报告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。

**5.11.5 报告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。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§ 6 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
报告期期初基金份额总额	11,535,392.73	1,329,407.99
报告期期间基金总申购份额	3,756,886.60	357,513.52
减：报告期期间基金总赎回份额	3,502,756.30	494,024.65
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	11,789,523.03	1,192,896.86

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况****7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,444.49
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,444.49
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	77.03

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

注：报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

## § 8 报告期末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比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,444.49	77.03	10,000,444.49	77.03	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	49,950.05	0.38	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,050,394.54	77.42	10,000,444.49	77.03	自合同生效之日起不少于三年

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	20210701-20210930	10,000,444.49	0.00	0.00	10,000,444.49	77.03%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

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：

1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。
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。
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。
4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。



## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、自 2021 年 7 月 2 日起，基金管理人增加北京广源达信基金销售有限公司为本基金的代销机构，同时参加其费率优惠活动。具体有关事项详见基金管理人于 2021 年 7 月 2 日披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加北京广源达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》。

2、自 2021 年 7 月 23 日起，基金管理人增加宁波银行股份有限公司为本基金的代销机构，同时参加其费率优惠活动。具体有关事项详见基金管理人于 2021 年 7 月 23 日披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告》。

3、本基金管理人于 2021 年 8 月 5 日发布公告，自 2021 年 8 月 4 日起，徐海军先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的合规总监，原合规总监刘嫣女士离任。

4、自 2021 年 8 月 16 日起，基金管理人增加一路财富（北京）基金销售有限公司为本基金的代销机构，同时参加其费率优惠活动。具体有关事项详见基金管理人于 2021 年 8 月 16 日披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加一路财富（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》。

5、自 2021 年 8 月 23 日起，基金管理人增加华泰期货有限公司为本基金的代销机构，同时参加其费率优惠活动。具体有关事项详见基金管理人于 2021 年 8 月 20 日披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰期货有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告》。

6、自 2021 年 8 月 26 日起，基金管理人增加上海爱建基金销售有限公司为本基金的代销机构，同时参加其费率优惠活动。具体有关事项详见基金管理人于 2021 年 8 月 25 日披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海爱建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》。

7、自 2021 年 8 月 30 日起，基金管理人增加东吴证券股份有限公司为本基金的代销机构，同时参加其费率优惠活动。具体有关事项详见基金管理人于 2021 年 8 月 27 日披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告》。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金睿选混合型发起式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、渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金在指定报刊上的各项公告。

### 10.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

### 10.3 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或中国证监会基金电子披露网站上查阅，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>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

渤海汇金证券资产管理有限公司

2021 年 10 月 27 日