

# 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资 基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 31 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。本中期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 2022 年 8 月 29 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 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>10</b>
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
<b>§4 管理人报告</b>	<b>12</b>
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	13
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
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>17</b>
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18

6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	21
<b>§7 投资组合报告 .....</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	44
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 .....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
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 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</b>

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
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
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
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	1,092,974.78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> <p>3、量化股票投资策略：</p>

(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，参与股指期货的投资。本基金将充分考虑股指期货的收益性、

	<p>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	麻众志	郭明
	联系电话	010-68784289	010-66105799
	电子邮箱	mazz@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桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518054	100140
法定代表人	刘嫣	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.bhhjmc.com">https://www.bhhjmc.com</a>
基金中期报告备置地点	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(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	-622,199.56
本期利润	-458,081.89
加权平均基金份额本期利润	-0.3174
本期加权平均净值利润率	-24.93%
本期基金份额净值增长率	-17.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	243,376.43
期末可供分配基金份额利润	0.2227
期末基金资产净值	1,336,351.21
期末基金份额净值	1.2227
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	22.27%

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。

#### 3.2 基金净值表现

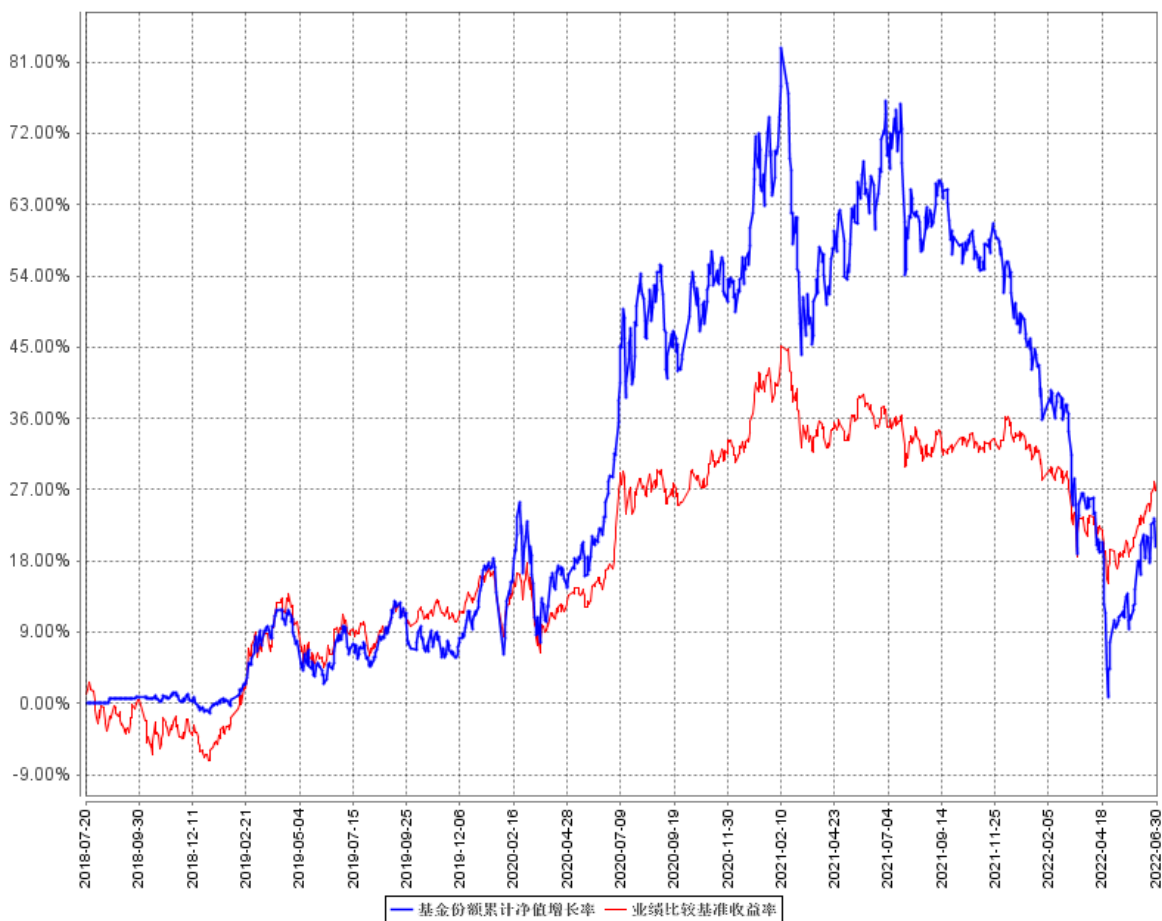
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.77%	1.71%	5.78%	0.64%	2.99%	1.07%
过去三个月	-2.07%	1.91%	4.29%	0.86%	-6.36%	1.05%
过去六个月	-17.95%	1.66%	-4.59%	0.87%	-13.36%	0.79%
过去一年	-29.87%	1.47%	-6.66%	0.75%	-23.21%	0.72%
过去三年	13.05%	1.43%	17.09%	0.76%	-4.04%	0.67%
自基金合同生效起至今	22.27%	1.27%	28.02%	0.80%	-5.75%	0.47%

注：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。

### 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：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2022年6月30日，本基金管理人共管理11只公募基金：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、渤海汇金汇裕87个月定期开放债券型证券投资基金、渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金、渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金创新价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金、渤海汇金兴宸一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 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	-	18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。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。2021 年 12 月 28 日起任渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。

#### 4.1.3 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、投资建议和实时投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对投资指令进行综合平衡，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，本基金未发现异常交易行为，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

2022 年上半年，国内国际环境错综复杂。美联储大幅收紧货币阀门令全球市场承压，国际地

缘冲突及国内疫情反复等因素带来的供给及需求冲击超出市场预期。A 股市场在上述因素影响下经历了持续四个月的下跌。5 月之后随着疫情防控形势好转、复工复产的推进以及稳增长政策持续发力，经济指标逐步修复，市场风险偏好有所回升，A 股市场迎来反弹行情。纵观 2022 年上半年，上证指数、沪深 300、创业板指涨跌幅分别为-6.63%、-9.22%、-15.41%。行业方面，仅煤炭行业上涨，其余行业均呈现不同程度下跌，其中电子、计算机、传媒、国防军工跌幅相对较大。

在渤海汇金量化汇盈产品的投资运作中，我们一直坚持基本面分析与量化相结合的理念。上半年我们持续关注受益于政策支持、景气度较高、业绩快速增长、低估值优势所带来的权益资产结构性机会。行业上以医药生物、化工材料以及新能源产业链相关行业为主进行配置的。选股方面，基金以量化选股模型为基础结合基本面分析构建股票组合，以期在长时间维度上获取稳定较好的投资收益。

#### 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 1.2227 元；本报告期基金份额净值增长率为-17.95%，业绩比较基准收益率为-4.59%。

#### 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 2022 年下半年，流动性环境仍保持合理充裕，稳增长政策作用持续发挥有望助推经济弱复苏，四季度将迎来重要会议和政策推出窗口期，在此背景下对于中期市场不宜过度悲观。当然国内经济修复并非一蹴而就，海外需求收缩、地缘冲突演进及疫情变化也将带来扰动。市场上行空间需要等待更多积极因素催化，短期市场将在超跌反弹后演绎震荡分化下的结构性行情，逐渐由情绪修复转向业绩验证。在基金投资思路上重点关注持续高景气度且盈利增速稳定的成长细分领域，受益于政策支持、具备估值优势的稳增长方向以及疫情好转预期下消费方向的边际修复机会。下半年在过于拥挤的部分方向上，由于存在短期估值消化的需要，涨势或者趋缓，或者进入震荡阶段，机会则会向景气产业链的纵深方向发展。一些此前关注度相对较少，且估值又具备一定相对优势的景气方向细分领域，可能会在下半年有产生超额收益的好机会，所以下半年可以向纵深去挖掘细分领域的中小成长类股票。

#### 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，估值委员会成员由公司总经理、分管投资部门的高级管理人

员、公募投资部门负责人、财务负责人、产品部及研究部负责人等人组成，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，中央国债登记结算有限责任公司，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，本基金自 2022 年 5 月 25 日至 2022 年 6 月 23 日连续 21 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人。本基金自 2019 年 2 月 19 日至 2022 年 6 月 30 日连续 818 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

## § 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——渤海汇金证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、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 托管人对本中期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本基金 2022 年中期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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,361.43	187,136.86
结算备付金		5,207.09	14,443.39
存出保证金		922.48	597.37
交易性金融资产	6.4.7.2	1,329,112.92	2,363,570.00
其中：股票投资		1,227,466.70	2,363,570.00
基金投资		-	-
债券投资		101,646.22	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,248.13	9.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	26.58
资产总计		1,351,852.05	2,565,784.19
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,580.21	-

应付赎回款		6,145.60	47.16
应付管理人报酬		1,661.17	3,360.65
应付托管费		276.84	560.13
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	4,837.02	23,490.51
负债合计		15,500.84	27,458.45
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,092,974.78	1,703,365.20
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	243,376.43	834,960.54
净资产合计		1,336,351.21	2,538,325.74
负债和净资产总计		1,351,852.05	2,565,784.19

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2227 元，基金份额总额 1,092,974.78 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-439,223.46	376,375.85
1.利息收入		362.88	548.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	362.88	548.80
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-603,802.61	390,592.48
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-612,774.33	378,564.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	166.26	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	8,805.46	12,027.95
以摊余成本计量的金融资		-	-

产终止确认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	164,117.67	-15,982.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	98.60	1,216.68
<b>减：二、营业总支出</b>		18,858.43	53,227.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,748.42	26,226.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,291.31	4,371.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	2,818.70	22,629.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-458,081.89	323,148.69
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-458,081.89	323,148.69
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-458,081.89	323,148.69

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,703,365.20	-	834,960.54	2,538,325.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,703,365.20	-	834,960.54	2,538,325.74

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-610,390.42	-	-591,584.11	-1,201,974.53
(一)、综合收益总额	-	-	-458,081.89	-458,081.89
(二)、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)	-610,390.42	-	-133,502.22	-743,892.64
其中: 1.基金申购款	21,877.67	-	3,901.25	25,778.92
2.基金赎回款	-632,268.09	-	-137,403.47	-769,671.56
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,092,974.78	-	243,376.43	1,336,351.21
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,845,194.02	-	1,707,562.97	4,552,756.99
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,845,194.02	-	1,707,562.97	4,552,756.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-921,911.20	-	-277,518.23	-1,199,429.43
(一)、综合收益总额	-	-	323,148.69	323,148.69
(二)、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)	-921,911.20	-	-600,666.92	-1,522,578.12
其中: 1.基金申购款	349,468.56	-	210,854.98	560,323.54
2.基金赎回款	-1,271,379.76	-	-811,521.90	-2,082,901.66
(三)、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)	-	-	-	-



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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 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不一致,具体请见会计政策变更的说明。

#### 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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021 年的比较数据将不作重述。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式,根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征,将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他

综合收益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”适用于以摊余成本计量的金融资产。“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。

本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息项目或应付利息”项目。

#### 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1

日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)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。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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 2022年6月30日
活期存款	15,361.43
等于: 本金	15,359.64
加: 应计利息	1.79
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
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	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
合计:	15,361.43

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,054,282.77	-	1,227,466.70	173,183.93
贵金属投资-金交所黄	-	-	-	-



金合约					
债券	交易所市场	100,202.00	1,496.22	101,646.22	-52.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	100,202.00	1,496.22	101,646.22	-52.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,154,484.77	1,496.22	1,329,112.92	173,131.93	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 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。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,357.25
其中：交易所市场	2,357.25
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	2,479.70
合计	4,837.02

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

本期期初	1,703,365.20	1,703,365.20
本期申购	21,877.67	21,877.67
本期赎回(以“-”号填列)	-632,268.09	-632,268.09
- 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	1,092,974.78	1,092,974.78

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 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
本期期初	1,426,264.75	-591,304.21	834,960.54
本期利润	-622,199.56	164,117.67	-458,081.89
本期基金份额交易产生的变动数	-343,357.86	209,855.64	-133,502.22
其中：基金申购款	11,143.56	-7,242.31	3,901.25
基金赎回款	-354,501.42	217,097.95	-137,403.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	460,707.33	-217,330.90	243,376.43

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	255.47
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	100.12
其他	7.29
合计	362.88

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-612,774.33
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-612,774.33

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	7,896,983.60
减：卖出股票成本总额	8,496,022.95
减：交易费用	13,734.98
买卖股票差价收入	-612,774.33

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	176.38
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-10.12
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	166.26

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	10.12
买卖债券差价收入	-10.12

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 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。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 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。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,805.46
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,805.46

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	164,117.67
——股票投资	164,169.67
——债券投资	-52.00
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	164,117.67

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	98.60
合计	98.60

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	2,479.70
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	339.00
其他费用	-
银行间账户维护费	-
合计	2,818.70

#### 6.4.7.24 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	15,087,069.58	100.00%	12,886,879.75	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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	100,202.00	100.00%	-	-

注：本基金上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

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债券回购交易。

**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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
渤海证券	4,536.57	100.00%	2,357.25	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
渤海证券	3,863.95	100.00%	1,015.96	100.00%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

## 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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,748.42	26,226.32
其中：支付销售机构的客户维护费	4,200.68	7,318.50

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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,291.31	4,371.03

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生转融通证券出借业务的重大关联交易事项。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	-	-
报告期初持有的基金份额	53,620.00	65,820.00
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	26,810.00	-
报告期末持有的基金份额	26,810.00	65,820.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.45%	3.42%

注：基金管理人投资本基金适用的认（申）购/赎回费按本基金基金合同和招募说明书规定执行。

**6.4.10.5.2 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：本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	15,361.43	255.47	212,085.04	459.46

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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 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（2022 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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券余额。

#### 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

本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关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建立了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，由稽核部门为风险管理的督导审计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。本基金的银行存款存放在托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理制度，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	101,646.22	-
合计	101,646.22	-

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债等无债项评级的债券。

#### 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

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金

管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量(2021 年 12 月 31 日：无)。

#### 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

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----	-------	--------	------	------	-----	----

2022 年 6 月 30 日						
资产						
银行存款	15,361.43	-	-	-	-	15,361.43
结算备付金	5,207.09	-	-	-	-	5,207.09
存出保证金	922.48	-	-	-	-	922.48
交易性金融资产	101,646.22	-	-	-	1,227,466.70	1,329,112.92
应收申购款	-	-	-	-	1,248.13	1,248.13
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	123,137.22	-	-	-	1,228,714.83	1,351,852.05
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	2,580.21	2,580.21
应付赎回款	-	-	-	-	6,145.60	6,145.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,661.17	1,661.17
应付托管费	-	-	-	-	276.84	276.84
应付交易费用	-	-	-	-	2,357.25	2,357.25
其他负债	-	-	-	-	2,479.77	2,479.77
负债总计	-	-	-	-	15,500.84	15,500.84
利率敏感度缺口	123,137.22	-	-	-	1,213,213.99	1,336,351.21
上年度末 2021 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	187,136.86	-	-	-	-	187,136.86
结算备付金	14,443.39	-	-	-	-	14,443.39
存出保证金	597.37	-	-	-	-	597.37
交易性金融资产	-	-	-	-	2,363,570.00	2,363,570.00
应收利息	-	-	-	-	26.58	26.58
应收申购款	-	-	-	-	9.99	9.99
资产总计	202,177.62	-	-	-	2,363,606.57	2,565,784.19
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	47.16	47.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,360.65	3,360.65
应付托管费	-	-	-	-	560.13	560.13
应付交易费用	-	-	-	-	3,490.51	3,490.51
其他负债	-	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	-	27,458.45	27,458.45
利率敏感度缺口	202,177.62	-	-	-	2,336,148.12	2,538,325.74

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	· 市场利率上升 25 个基点	-82.07	-
	市场利率下降 25 个基点	82.34	-

#### 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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	1,227,466.70	91.85	2,363,570.00	93.12
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	1,227,466.70	91.85	2,363,570.00	93.12

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	41,571.98	63,750.02
	业绩比较基准下降5%	-41,571.98	-63,750.02

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,227,466.70	2,363,570.00
第二层次	101,646.22	-
第三层次	-	-
合计	1,329,112.92	2,363,570.00

#### **6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

#### **6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### **6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

#### **6.4.15 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	1,227,466.70	90.80
	其中：股票	1,227,466.70	90.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	101,646.22	7.52
	其中：债券	101,646.22	7.52
	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	-	-
	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	20,568.52	1.52
8	其他各项资产	2,170.61	0.16
9	合计	1,351,852.05	100.00

### 7.2 报告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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	832,669.70	62.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	113,778.00	8.51
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,220.00	2.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	120,665.00	9.03
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	79,194.00	5.93
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	53,940.00	4.04
	合计	1,227,466.70	91.85

### 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	300347	泰格医药	600	68,670.00	5.14
2	002594	比亚迪	200	66,698.00	4.99
3	300390	天华超净	700	61,180.00	4.58
4	601668	中国建筑	11,400	60,648.00	4.54
5	300593	新雷能	1,400	58,114.00	4.35
6	600673	东阳光	6,000	53,940.00	4.04
7	688516	奥特维	200	53,390.00	4.00
8	000498	山东路桥	5,500	53,130.00	3.98
9	600763	通策医疗	300	52,332.00	3.92
10	603259	药明康德	500	51,995.00	3.89
11	300829	金丹科技	1,600	51,872.00	3.88
12	002801	微光股份	1,700	50,745.00	3.80
13	600141	兴发集团	1,100	48,389.00	3.62
14	600596	新安股份	2,200	47,630.00	3.56
15	002258	利尔化学	2,000	47,240.00	3.53
16	300037	新宙邦	800	42,048.00	3.15
17	300926	博俊科技	1,800	42,030.00	3.15
18	000733	振华科技	300	40,791.00	3.05
19	688385	复旦微电	600	39,114.00	2.93
20	300327	中颖电子	770	38,353.70	2.87
21	002007	华兰生物	1,500	34,200.00	2.56
22	688033	天宜上佳	1,600	33,984.00	2.54
23	300595	欧普康视	500	28,595.00	2.14
24	688668	鼎通科技	400	28,136.00	2.11
25	002410	广联达	500	27,220.00	2.04

26	300015	爱尔眼科	600	26,862.00	2.01
27	003038	鑫铂股份	400	20,160.00	1.51

## 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	300347	泰格医药	138,624.00	5.46
2	600141	兴发集团	126,779.00	4.99
3	603799	华友钴业	113,844.00	4.49
4	002539	云图控股	86,840.00	3.42
5	300829	金丹科技	86,526.00	3.41
6	002969	嘉美包装	85,139.00	3.35
7	300782	卓胜微	84,690.00	3.34
8	300181	佐力药业	84,458.00	3.33
9	600727	鲁北化工	83,414.00	3.29
10	600096	云天化	82,975.00	3.27
11	601899	紫金矿业	82,643.00	3.26
12	603155	新亚强	82,624.00	3.26
13	002455	百川股份	82,322.00	3.24
14	603599	广信股份	82,312.00	3.24
15	603067	振华股份	82,275.00	3.24
16	003019	宸展光电	81,962.00	3.23
17	002601	龙佰集团	81,087.00	3.19
18	300458	全志科技	77,968.00	3.07
19	688668	鼎通科技	77,645.32	3.06
20	002460	赣锋锂业	75,305.00	2.97
21	601166	兴业银行	74,199.00	2.92
22	603026	石大胜华	71,162.00	2.80
23	000333	美的集团	69,611.00	2.74
24	000408	藏格矿业	66,860.00	2.63
25	601677	明泰铝业	65,362.00	2.58
26	300938	信测标准	64,235.00	2.53
27	601390	中国中铁	62,990.00	2.48

28	601668	中国建筑	62,818.00	2.47
29	300918	南山智尚	62,558.00	2.46
30	603339	四方科技	61,538.00	2.42
31	300504	天邑股份	60,550.00	2.39
32	000630	铜陵有色	59,600.00	2.35
33	002594	比亚迪	58,978.00	2.32
34	300818	耐普矿机	58,358.00	2.30
35	688033	天宜上佳	58,308.00	2.30
36	002948	青岛银行	57,343.00	2.26
37	603948	建业股份	57,200.00	2.25
38	002182	云海金属	56,668.00	2.23
39	300037	新宙邦	55,373.00	2.18
40	002410	广联达	54,992.00	2.17
41	000498	山东路桥	53,530.00	2.11
42	603259	药明康德	52,840.00	2.08

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	601899	紫金矿业	126,712.00	4.99
2	600900	长江电力	109,802.00	4.33
3	603799	华友钴业	106,299.00	4.19
4	601166	兴业银行	96,885.00	3.82
5	600036	招商银行	96,020.00	3.78
6	002594	比亚迪	95,256.00	3.75
7	600096	云天化	89,555.00	3.53
8	002539	云图控股	79,280.00	3.12
9	603599	广信股份	78,351.00	3.09
10	600141	兴发集团	77,766.00	3.06
11	603067	振华股份	77,646.00	3.06
12	003019	宸展光电	75,678.00	2.98
13	300782	卓胜微	74,690.00	2.94
14	600727	鲁北化工	71,232.00	2.81
15	300347	泰格医药	71,126.00	2.80

16	002969	嘉美包装	70,952.00	2.80
17	002455	百川股份	70,551.00	2.78
18	601677	明泰铝业	70,309.00	2.77
19	300181	佐力药业	69,823.00	2.75
20	603155	新亚强	69,190.00	2.73
21	601985	中国核电	67,432.00	2.66
22	002460	赣锋锂业	66,347.00	2.61
23	603181	皇马科技	65,444.00	2.58
24	300938	信测标准	64,417.40	2.54
25	000333	美的集团	63,281.00	2.49
26	002601	龙佰集团	62,856.00	2.48
27	300458	全志科技	61,736.00	2.43
28	002142	宁波银行	60,752.00	2.39
29	601390	中国中铁	60,100.00	2.37
30	688668	鼎通科技	58,469.00	2.30
31	002948	青岛银行	56,035.20	2.21
32	600048	保利发展	54,464.00	2.15
33	000408	藏格矿业	54,038.00	2.13
34	600690	海尔智家	53,826.00	2.12
35	603026	石大胜华	52,804.00	2.08
36	603339	四方科技	52,200.00	2.06
37	000002	万科 A	51,897.00	2.04

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	7,195,749.98
卖出股票收入（成交）总额	7,896,983.60

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	101,646.22	7.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-



	其中：政策性金融债	-	-
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	101,646.22	7.61

## 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	019664	21 国债 16	1,000	101,646.22	7.61

## 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 本基金投资股指期货的投资政策

无

## 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

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 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	922.48
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,248.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,170.61

**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
207	5,280.07	26,810.00	2.45%	1,066,164.78	97.55%

### 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	138,315.49	12.65%

### 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	1,703,365.20
本报告期基金总申购份额	21,877.67
减：本报告期基金总赎回份额	632,268.09
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	1,092,974.78

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议了《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》，并由参加大会的基金份额持有人对本次会议议案进行表决。根据计票结果，参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额未达到《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》规定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效条件。具体有关事项详见基金管理人于 2022 年 6 月 10 日披露的《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会议情况的公告》。

### 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：

1、本基金管理人于 2022 年 01 月 01 日发布公告，自 2021 年 12 月 31 日起，魏文婷女士担任渤海汇金证券资产管理有限公司的总经理助理，原副总经理王琦先生离任。

2、本基金管理人于 2022 年 01 月 11 日发布公告，决定将渤海证券股份有限公司派驻渤海汇金证券资产管理有限公司的董事徐海军同志变更为方超同志。

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，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 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、托管人及其高级管理人员受到稽查或者处罚的情况。

### 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	15,087,069.58	100.00%	4,536.57	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，本公司作为证券公司子公司于 2020 年上半年方获得上海交易所租用其他券商交易单元的资格，已逐步按照公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜，后续将按照监管政策要求完善交易单元租用事宜。

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	100,202.00	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	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（副总经理）变更公告	公司网站、证券时报	2022 年 1 月 1 日
2	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	公司网站	2022 年 1 月 1 日
3	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	证券时报	2022 年 1 月 4 日
4	关于渤海汇金证券资产管理有限公司董事会成员变更的公告	公司网站	2022 年 1 月 11 日
5	关于渤海汇金证券资产管理有限公司	证券时报	2022 年 1 月 12 日

	公司董事会成员变更的公告		
6	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站	2022 年 1 月 24 日
7	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 4 季度报告的提示性公告	证券时报	2022 年 1 月 24 日
8	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站	2022 年 3 月 31 日
9	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告的提示性公告	证券时报	2022 年 3 月 31 日
10	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站	2022 年 4 月 22 日
11	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 1 季度报告的提示性公告	证券时报	2022 年 4 月 22 日
12	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	公司网站、证券时报	2022 年 4 月 26 日
13	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第一次提示性公告	公司网站、证券时报	2022 年 4 月 27 日
14	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第二次提示性公告	公司网站、证券时报	2022 年 4 月 28 日
15	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金暂停申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站、证券时报	2022 年 4 月 29 日
16	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站	2022 年 5 月 13 日
17	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）（2022 年第 1 号）	公司网站	2022 年 5 月 13 日
18	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下 8 只基金招募说明书（更新）	证券时报	2022 年 5 月 13 日

	及基金产品资料概要（更新）提示性公告		
19	渤海汇金证券资产管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	公司网站、证券时报	2022 年 5 月 30 日
20	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会议情况的公告	公司网站、证券时报	2022 年 6 月 10 日
21	渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金恢复申购（含定期定额投资）业务的公告	公司网站、证券时报	2022 年 6 月 10 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

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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20220101-20220323	479,593.43	0.00	350,000.00	129,593.43	11.86%
	2	20220325-20220630	296,714.86	0.00	0.00	296,714.86	27.15%

#### 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。

### 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

2022 年 8 月 31 日