

渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

清算报告

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2022年12月26日

清算报告公告日：2022年12月30日

§ 1 重要提示

渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2017〕1193号《关于准予渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册。经向中国证监会备案，《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于2018年2月11日正式生效。

根据《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》等法律法规规定及《基金合同》约定，本基金以通讯方式组织召开了渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会，审议《关于终止渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并于2022年12月8日表决通过了《关于终止渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，会议决议自该日起生效，2022年12月21日为本基金最后运作日。基金管理人于2022年12月9日披露了《渤海汇金证券资产管理有限公司关于渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金从2022年12月22日起进入清算期，由基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成了基金财产清算小组，履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金概况

基金名称	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金
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
基金最后运作日（2022年12月21日）基金份额总额	10,618,335.17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 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</p>

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。

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、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。

(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。

(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。

7、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与股指期货的投资。本基金将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，选择流动性较高的、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。

8、资产支持证券投资策略

本基金将通过分析宏观经济等多个因素的研究预

	<p>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。本基金将通过权证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
基金最后运作日（2022 年 12 月 21 日）下属分级基金的份额总额	10,414,569.68 份	203,765.49 份
下属分级基金的风险收益特征	-	-

§ 3 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可〔2017〕1193号《关于准予渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由渤海汇金证券资产管理有限公司管理，并依照法律法规、《基金合同》等规定自2018年1月9日至2018年2月7日公开募集。《基金合同》于2018年2月11日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额（含利息结转份额）总额为285,984,563.38份。

自2018年2月11日至2022年12月21日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

根据《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》、《基金合同》等有关规定，本基金基金份额持有人大会于2022年12月8日表决通过了《关于终止渤海汇

金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本基金自 2022 年 12 月 22 日进入清算期。

§ 4 财务会计报告

4.1 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 21 日

单位：人民币元

	最后运作日 2022 年 12 月 21 日
资产：	
银行存款	13,119,848.23
结算备付金	27,645.90
存出保证金	1,232.49
资产总计	13,148,726.62
负债和净资产	
负债：	
应付赎回款	36,841.91
应付管理人报酬	9,438.22
应付托管费	1,573.04
应付销售服务费	171.03
其他负债	17,604.01
负债合计	65,628.21
净资产：	
实收基金	10,618,335.17
未分配利润	2,464,763.24
净资产合计	13,083,098.41
负债和净资产总计	13,148,726.62

注：截至最后运作日 2022 年 12 月 21 日，渤海汇金睿选混合 A 基金份额净值 1.2328 元，基金份额总额 10,414,569.68 份；渤海汇金睿选混合 C 基金份额净值 1.1965 元，基金份额总额 203,765.49 份。渤海汇金睿选混合份额总额合计为 10,618,335.17 份。

§ 5 清算情况

清算期间自 2022 年 12 月 22 日至 2022 年 12 月 26 日止，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及清算期间的清算损益情况如下：

5.1 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定，清算费用应由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.2 资产处置情况

5.2.1 本基金最后运作日银行存款及其应计利息总和为人民币 13,119,848.23 元，其中托管账户存款为 13,119,720.68 元，应计银行存款利息为 127.55 元。应计利息款项将于结息后划入本基金托管账户。

5.2.2 本基金最后运作日结算备付金及其应计利息总和为人民币 27,645.90 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金为人民币 10,556.14 元，对应应计结算备付金利息为 0.48 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金为人民币 17,088.51 元，对应应计结算备付金利息为 0.77 元。应计利息款项将于结息后划入本基金托管账户。

5.2.3 本基金最后运作日存出保证金及其应计利息总和为人民币 1,232.49 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为 475.20 元，应计利息为 0.02 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为 757.24 元，应计利息为 0.03 元。应计利息款项将于结息后划入本基金托管账户。

5.3 负债清偿情况

5.3.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 36,841.91 元，该款项已于 2022 年 12 月 23 日支付完毕。

5.3.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 9,438.22 元，该款项已于 2022 年 12 月 22 日支付。

5.3.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,573.04 元，该款项已于 2022 年 12 月 22 日支付。

5.3.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 171.03 元，该款项已于 2022 年 12 月 22 日支付。

5.3.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 17,604.01 元。其中，应付赎回费为人民币 17.56 元，该款项已于 2022 年 12 月 22 日支付；预提审计费为人民币 10,000.00 元，该款项已于 2022 年 12 月 22 日支付；应付交易费用为人民币 7,586.45 元，该款项已于 2022 年 12 月 22 日支付。

5.4 清算期间的损益情况

单位：人民币元

项目	金额
一、清算期间收益	648.76
利息收入	639.88
赎回费收入	8.88
二、清算期间费用	-20,283.00
律师费	-20,000.00
划款手续费	-283.00
三、清算期间净收益	-19,634.24

注：利息收入为自 2022 年 12 月 22 日至 2022 年 12 月 26 日止清算期间的银行存款、结算备付金、保证金利息收入。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 12 月 21 日基金净资产	13,083,098.41

加：清算期间净收益	-19,634.24
减：基金净赎回金额（于2022年12月22日确认的投资者赎回申请）	24,370.66
二、清算结束日2022年12月26日基金净资产	13,039,093.51

资产处置及负债清偿后，本基金2022年12月26日归属于剩余基金份额持有人的净资产为人民币13,039,093.51元，其中剩余未到账资产为人民币29,645.82元，包括结算备付金人民币27,644.65元，存出保证金人民币1,232.44元，应计银行存款、结算备付金、存出保证金利息人民币768.73元。支付清算款之日前未到账的部分，将由基金管理人以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

自清算期结束日次日（2022年12月27日）至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的银行存款、结算备付金、存出保证金孳生的利息归基金份额持有人所有，最终支付清算款金额以本基金登记机构的记录为准。基金管理人垫付的资金自资金到账日起至托管账户销户为止孳生的利息归基金管理人所有，在托管账户销户前向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

5.6 基金财产清算报告的告知及剩余财产分配安排

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

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金清算财务报表及审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于〈渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金清算报告〉的法律意见》

6.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

6.3 查阅方式

上述文件可在营业时间内到渤海汇金证券资产管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-5988/400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2022年12月26日